

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 der Kommission im Hinblick auf die Verwendung von Codes für die Meldung von Derivatekontrakten****(Text von Bedeutung für den EWR)**

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

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 10,

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 ⁽²⁾, insbesondere auf Artikel 9 Absatz 6,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Wenn Gegenparteien Transaktionsregistern oder der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (im Folgenden „ESMA“) Einzelheiten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften melden, sollte diese Meldung in einem harmonisierten Format erfolgen, um die Erfassung, die Aggregation und den Vergleich zwischen Transaktionsregistern zu erleichtern. Um die Kosten für die meldenden Gegenparteien möglichst gering zu halten, sollte das Format für die Meldung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften soweit möglich mit dem für die Meldung von Derivatekontrakten gemäß Artikel 9 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates vorgeschriebenen Format übereinstimmen. Daher wird in dieser Verordnung das Format aller zu meldenden Felder vorgeschrieben und werden die Meldungen durch Verweis auf eine in der Finanzbranche weitverbreitete ISO-Norm vereinheitlicht.
- (2) Das globale System der Rechtsträgerkennung (im Folgenden „LEI“) wurde mittlerweile vollständig umgesetzt, sodass jede Gegenpartei eines Wertpapierfinanzierungsgeschäfts juristische Personen in ihren Meldungen ausschließlich anhand dieses Systems benennen sollte. Damit Gegenparteien das LEI-System wirksam in Anspruch nehmen können, sollten sie sicherstellen, dass die Referenzdaten ihrer LEI gemäß den Bedingungen eines akkreditierten LEI-Emittenten (lokale operative Stelle) verlängert werden. Derzeit wird daran gearbeitet, auch Zweigniederlassungen juristischer Personen durch das globale LEI-System zu erfassen. Bis diese Systemänderung abgeschlossen ist, für die Zwecke der Meldung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften für geeignet befunden wurde und diese Verordnung entsprechend geändert wird, sollte bei Abschlüssen von Wertpapierfinanzierungsgeschäften über eine Zweigniederlassung einer Gegenpartei zur Identifizierung dieser Zweigniederlassung der ISO-Code des Landes verwendet werden, in dem diese sich befindet.
- (3) Aktuell wird auch ein globales System für eindeutige Transaktionskennungen (unique trader identifier — „UTI“) entwickelt, das der Identifizierung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften dienen wird. Bis die Entwicklung dieses globalen UTI-Systems abgeschlossen ist, das System für die Zwecke der Meldung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften für geeignet befunden wurde und diese Verordnung entsprechend geändert wird, sollten Wertpapierfinanzierungsgeschäfte mittels einer UTI gekennzeichnet werden, auf die sich die Gegenparteien geeinigt haben.
- (4) In Artikel 4a der Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 der Kommission ⁽³⁾ ist ein Verfahren zur Bestimmung der Stelle beschrieben, die für die Zwecke der Meldung von Derivatekontrakten für die UTI-Generierung zuständig ist, wenn sich die Gegenparteien nicht darauf einigen können, wer die UTI generiert. Um die Kohärenz zwischen Meldungen von Derivatekontrakten und Wertpapierfinanzierungsgeschäften zu gewährleisten, sollte für Gegenparteien, die Wertpapierfinanzierungsgeschäfte melden, ein ähnliches Verfahren eingeführt werden.

⁽¹⁾ ABl. L 337 vom 23.12.2015, S. 1.

⁽²⁾ ABl. L 201 vom 27.7.2012, S. 1.

⁽³⁾ 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).

- (5) Derzeit gibt es keine gemeinsame Marktpraxis für die Bestimmung der Seite der Gegenpartei bei Wertpapierfinanzierungsgeschäften. Daher sollten spezifische Regeln festgelegt werden, die eine präzise und kohärente Identifizierung von Sicherungsgeber und Sicherungsnehmer eines Wertpapierfinanzierungsgeschäfts gewährleisten.
- (6) Für einzelne Wertpapierfinanzierungsgeschäfte können — z. B. im Falle sukzessiver Änderungen — mehrere Meldungen erfolgen. Um sicherzustellen, dass jede Meldung zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften und jedes einzelne Wertpapierfinanzierungsgeschäft insgesamt richtig verstanden wird, sollten die Meldungen in der zeitlichen Abfolge, in der die gemeldeten Ereignisse eingetreten sind, erfolgen.
- (7) Um die Belastung, die mit der Meldung von Änderungen, insbesondere beim Wert der Sicherheiten, bei den hinterlegten oder erhaltenen Einschuss- und Nachschusszahlungen und bei der Weiterverwendung der Sicherheiten verbunden ist, zu verringern, sollte die Meldung dieser Einzelheiten als Tagesendstand nur dann erfolgen, wenn sie von zuvor gemeldeten Einzelheiten abweichen.
- (8) Die Einzelheiten ausstehender Lombardkredite sind jeweils als Tagesendstand zu melden, wenn ein Netto-Cash-Debet in der Basiswährung vorliegt oder die Short-Position einer Gegenpartei einen positiven Marktwert hat.
- (9) Der Marktwert der verliehenen oder entliehenen Wertpapiere ist jeweils als Tagesendstand zu melden. Ebenso sollten Gegenparteien den Marktwert von Sicherheiten jeweils als Tagesendstand melden.
- (10) Die vorliegende Verordnung stützt sich auf den Entwurf technischer Durchführungsstandards, der der Kommission von der ESMA gemäß dem in Artikel 15 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde) ⁽⁴⁾ genannten Verfahren vorgelegt wurde.
- (11) Die ESMA hat zu diesem Standardentwurf offene öffentliche Konsultationen durchgeführt, die damit verbundenen potenziellen Kosten- und Nutzeffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt.
- (12) Wie bei der Meldung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften ist auch bezüglich der Meldung von Derivatekontrakten die Entwicklung bestimmter Kennungen und Codes noch nicht abgeschlossen. Bis diese Kennungen und Codes zur Verfügung stehen, für die Zwecke der Meldung für geeignet befunden werden und die Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 entsprechend geändert wird, sind dieser Verordnung zufolge bei der Klassifizierung von Derivaten, für die weder ein ISIN-Code nach ISO 6166 noch ein AII-Code vorhanden ist, ein CFI-Code nach ISO 10692 und für die Identifizierung von Derivatemeldungen eindeutige Transaktionskennungen zu verwenden. Zur Gewährleistung von Rechtssicherheit in Bezug auf das Verfahren zur Änderung der Anforderungen an die Meldung von Derivatekontrakten und der erforderlichen Kohärenz zwischen der Meldung von Derivaten und Wertpapierfinanzierungsgeschäften sollte in der Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 nur auf die derzeit für diese Meldungen geltenden Anforderungen verwiesen werden.
- (13) Die Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 sollte daher entsprechend geändert werden —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

Artikel 1

Datenstandards und -formate für die Meldung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften

Die Einzelheiten eines Wertpapierfinanzierungsgeschäfts werden in einer Meldung gemäß Artikel 4 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2015/2365 gemäß den in Anhang I Tabellen 1 bis 5 spezifizierten Standards und Formaten angegeben. Diese Meldung wird in einer gemeinsamen elektronischen, maschinenlesbaren Form und in einem gemeinsamen XML-Format nach der ISO-20022-Methodik übermittelt.

⁽⁴⁾ ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84.

*Artikel 2***Identifizierung von Gegenparteien und anderen juristischen Personen**

(1) In der in Artikel 1 genannten Meldung werden folgende juristische Personen durch Angabe einer Kennung für Rechtsträger (im Folgenden „LEI“) nach ISO 17442 identifiziert:

- a) Begünstigte, bei denen es sich um juristische Personen handelt,
- b) Maklerfirmen,
- c) gemäß der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 zugelassene zentrale Gegenparteien (im Folgenden „CCP“),
- d) Clearingmitglieder,
- e) Leihstellen,
- f) teilnehmende Zentralverwahrer,
- g) Gegenparteien, bei denen es sich um juristische Personen handelt,
- h) Tri-Party-Agenten,
- i) Meldung einreichende Stellen,
- j) Emittenten von Wertpapieren, die im Rahmen eines Wertpapierfinanzierungsgeschäfts verliehen, entliehen oder als Sicherheit hinterlegt wurden.

(2) Gegenparteien eines Wertpapierfinanzierungsgeschäfts stellen sicher, dass die Referenzdaten ihres LEI-Codes nach ISO 17442 gemäß den Bedingungen einer akkreditierten lokalen operativen Stelle des globalen LEI-Systems verlängert werden.

(3) Wird ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft über eine Zweigniederlassung einer Gegenpartei abgeschlossen, so werden Zweigniederlassungen in der in Artikel 1 genannten Meldung mittels des in Anhang I Tabelle 1 Felder 7 und 8 angegebenen Codes identifiziert.

*Artikel 3***Eindeutige Transaktionskennung**

(1) Meldungen werden durch Angabe einer von den Gegenparteien vereinbarten eindeutigen Transaktionskennung („UTI“) in dem in Anhang I Tabelle 2 Feld 1 genannten Format identifiziert.

(2) Wenn Gegenparteien sich nicht darauf einigen können, welche Stelle für die Generierung der UTI für die Meldung zuständig ist, so bestimmen sie die für die Generierung der UTI zuständige Stelle wie folgt:

- a) Bei zentral ausgeführten und geclearten Wertpapierfinanzierungsgeschäften wird die UTI beim Clearing von der CCP für das Clearingmitglied generiert. Eine weitere UTI wird vom Clearingmitglied für seine Gegenpartei generiert;
- b) bei zentral ausgeführten, aber nicht zentral geclearten Wertpapierfinanzierungsgeschäften wird die UTI vom ausführenden Handelsplatz für sein Mitglied generiert;
- c) bei zentral bestätigten und geclearten Wertpapierfinanzierungsgeschäften wird die UTI beim Clearing von der CCP für das Clearingmitglied generiert. Eine weitere UTI wird vom Clearingmitglied für seine Gegenpartei generiert;
- d) bei auf elektronischem Wege zentral bestätigten, aber nicht zentral geclearten Wertpapierfinanzierungsgeschäften wird die UTI von der Transaktionsbestätigungsplattform bei der Bestätigung generiert;
- e) für alle nicht unter den Buchstaben a bis d genannten Wertpapierfinanzierungsgeschäfte gilt Folgendes:
 - i) Schließen finanzielle Gegenparteien ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft mit nichtfinanziellen Gegenparteien ab, wird die UTI von der finanziellen Gegenpartei generiert;
 - ii) bei allen Wertpapierverleih- oder -leihgeschäften mit Ausnahme der unter Ziffer i) genannten Geschäfte wird die UTI von dem in Artikel 4 genannten Sicherungsgeber generiert;

- iii) bei allen Wertpapierfinanzierungsgeschäften mit Ausnahme der unter den Ziffern i) und ii) genannten Geschäfte wird die UTI von dem in Artikel 4 genannten Sicherungsnehmer generiert.
- (3) Die Gegenpartei, die die UTI generiert, teilt diese der anderen Gegenpartei zeitnah mit, sodass diese ihrer Meldepflicht nachkommen kann.

Artikel 4

Seite der Gegenpartei

- (1) Die in Anhang I Tabelle 1 Feld 9 genannte Seite der Gegenpartei des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts wird gemäß den Absätzen 2 bis 4 bestimmt.
- (2) Bei Pensionsgeschäften sowie „Buy-sell back“- und „Sell-buy back“-Geschäften wird die Gegenpartei, die Wertpapiere, Waren oder garantierte Rechte bezüglich Titeln auf Wertpapiere oder Waren als Anfangs- oder Kassaposition des Geschäfts kauft und sich verpflichtet, diese zu einem künftigen Zeitpunkt zu einem bestimmten Preis als Abschluss- oder Terminposition des Geschäfts zu veräußern, in Anhang I Tabelle 1 Feld 9 als Sicherungsnehmer identifiziert. Die Gegenpartei, die diese Wertpapiere, Waren oder garantierte Rechte verkauft, wird in Anhang I Tabelle 1 Feld 9 als Sicherungsgeber identifiziert.
- (3) Bei Wertpapier- oder Warenleih- und verleihgeschäften wird die Gegenpartei, die die Wertpapiere oder Waren unter der Bedingung verleiht, dass der Entleiher zu einem künftigen Zeitpunkt oder auf Ersuchen des Übertragenden gleichwertige Wertpapiere oder Waren zurückgibt, in Anhang I Tabelle 1 Feld 9 als Sicherungsnehmer identifiziert. Die Gegenpartei, die diese Wertpapiere oder Waren entleiht, wird in Anhang I Tabelle 1 Feld 9 als Sicherungsgeber identifiziert.
- (4) Bei Lombardgeschäften wird der Kreditnehmer, d. h. die Gegenpartei, an die der Kredit im Austausch gegen Sicherheiten vergeben wird, in Anhang I Tabelle 1 Feld 9 als Sicherungsgeber identifiziert. Der Kreditgeber, d. h. die Gegenpartei, die den Kredit im Austausch gegen Sicherheiten gewährt, wird in Anhang I Tabelle 1 Feld 9 als Sicherungsnehmer identifiziert.

Artikel 5

Häufigkeit der Meldung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften

- (1) Alle Meldungen der Einzelheiten eines Wertpapierfinanzierungsgeschäfts gemäß Artikel 1 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/356 der Kommission ^(?) erfolgen in der zeitlichen Abfolge, in der die gemeldeten Ereignisse eingetreten sind.
- (2) Gegenparteien eines Lombardgeschäfts melden die Einzelheiten ausstehender Lombardkredite jeweils als Tagesendstand, wenn ein Netto-Cash-Debet in der Basiswährung vorliegt oder die Short-Position einer Gegenpartei einen positiven Marktwert hat.
- (3) Gegenparteien ausstehender Wertpapierfinanzierungsgeschäfte weisen jede Änderung der Einzelheiten zu den Sicherheiten in Anhang I Tabelle 2 Felder 75 bis 94 als „Sicherheitenaktualisierung“ aus. Die Gegenparteien melden diese geänderten Einzelheiten bis zur Meldung der Beendigung des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts jeweils als Tagesendstand oder sie melden das Wertpapierfinanzierungsgeschäft als „Fehler“ oder bis Ende der Laufzeit des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts, je nachdem, welcher Zeitpunkt zuerst eintritt.
- (4) Gegenparteien ausstehender Wertpapierfinanzierungsgeschäfte weisen jede Änderung des Marktwerts der verliehenen oder geliehenen Sicherheiten als Tagesendstand in Anhang I Tabelle 2 Feld 57 als „Bewertungsaktualisierung“ aus. Die Gegenparteien melden diesen geänderten Marktwert bis zur Meldung der Beendigung des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts als Tagesendstand oder sie melden das Wertpapierfinanzierungsgeschäft als „Fehler“ oder bis Ende der Laufzeit des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts, je nachdem, welcher Zeitpunkt zuerst eintritt.

^(?) 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 (siehe Seite 1 dieses Amtsblatts).

(5) Die Gegenparteien weisen jede Änderung des Gesamtbetrags der für alle geclarten Wertpapierfinanzierungsgeschäfte geleisteten oder erhaltenen Ein- und Nachschusszahlungen als Tagesendstand in Anhang I Tabelle 3 Felder 8 bis 19 als „Aktualisierung der Ein-/Nachschusszahlungen“ aus, nachdem sie den Gesamtbetrag der hinterlegten oder erhaltenen Ein- und Nachschusszahlungen zuerst als „Neu“ ausgewiesen haben.

(6) Die Gegenparteien weisen jede Änderung des Werts weiterverwendeter Sicherheiten, reinvestierter Barmittel und der Finanzierungsquellen als Tagesendstand in Anhang I Tabelle 4 Felder 8 bis 14 als „Aktualisierung der Weiterverwendung“ aus, nachdem sie die entsprechenden Werte zuerst als „Neu“ ausgewiesen haben.

Artikel 6

Änderung der Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012

Die Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 wird wie folgt geändert:

1. Artikel 4 wird wie folgt geändert:

a) Absatz 7 erhält folgende Fassung:

„Das Derivat wird in Tabelle 2 Feld 4 des Anhangs mithilfe der Kennziffer zur Klassifizierung von Finanzinstrumenten (CFI) nach ISO 10692 klassifiziert.“;

b) die Absätze 8 und 9 werden gestrichen.

2. Artikel 4a Absatz 1 erhält folgende Fassung:

„1. Meldungen werden über eine von den Gegenparteien vereinbarte eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer identifiziert.“;

3. Der Anhang wird durch den Wortlaut des Anhangs II der vorliegenden Verordnung ersetzt.

Artikel 7

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

**Formate für Meldungen der Einzelheiten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß Artikel 4
Absätze 1 und 5 der Verordnung (EU) 2015/2365**

Tabelle 1

Angaben zur Gegenpartei

| Nr. | Feld | Format |
|-----|----------------------------------|---|
| 1 | Meldezeitstempel | Datumsangabe nach ISO 8601, UTC-Zeit (koordinierte Weltzeit), d. h. (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ) |
| 2 | Meldung einreichende Stelle | 20-stellige alphanumerische Rechtsträger-Kennung nach ISO 17442 (LEI-Code) |
| 3 | Meldende Gegenpartei | 20-stellige alphanumerische Rechtsträger-Kennung nach ISO 17442 (LEI-Code) |
| 4 | Art der meldenden Gegenpartei | „F“ = finanzielle Gegenpartei „N“ = nichtfinanzielle Gegenpartei |
| 5 | Sektor der meldenden Gegenpartei | <p>Taxonomie für finanzielle Gegenparteien:</p> <p>„CDTI“ = gemäß der Richtlinie 2013/36/EU des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽¹⁾ oder der Verordnung (EU) Nr. 1024/2013 des Rates ⁽²⁾ zugelassenes Kreditinstitut oder in einem Drittstaat niedergelassener Rechtsträger, der gemäß diesem Rechtsakt zugelassen oder registriert werden muss</p> <p>„INVF“ = gemäß der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽³⁾ zugelassene Wertpapierfirma oder in einem Drittstaat niedergelassener Rechtsträger, der gemäß diesem Rechtsakt zugelassen oder registriert werden muss</p> <p>„INUN“ = gemäß der Richtlinie 2009/138/EG des Europäischen Parlaments und des Rates (Solvabilität II) ⁽⁴⁾ zugelassenes Versicherungsunternehmen oder in einem Drittstaat niedergelassener Rechtsträger, der gemäß diesem Rechtsakt zugelassen oder registriert werden muss</p> <p>„AIFD“ = AIF, der durch gemäß der Richtlinie 2011/61/EU des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽⁵⁾ zugelassene oder registrierte AIFM oder durch einen in einem Drittstaat niedergelassenen Rechtsträger verwaltet wird, der gemäß diesem Rechtsakt zugelassen oder registriert werden muss</p> <p>„ORPI“ = gemäß der Richtlinie 2003/41/EG des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽⁶⁾ zugelassene oder registrierte Einrichtung der betrieblichen Altersversorgung oder ein in einem Drittstaat niedergelassener Rechtsträger, der gemäß diesem Rechtsakt zugelassen oder registriert werden muss</p> <p>„CCPS“ = gemäß der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽⁷⁾ zugelassene zentrale Gegenpartei oder in einem Drittstaat niedergelassener Rechtsträger, der gemäß diesem Rechtsakt zugelassen oder registriert werden muss</p> <p>„REIN“ = gemäß der Solvabilität II-Richtlinie zugelassenes Rückversicherungsunternehmen oder in einem Drittstaat niedergelassener Rechtsträger, der gemäß diesem Rechtsakt zugelassen oder registriert werden muss</p> <p>„CSDS“ = gemäß der Verordnung (EU) Nr. 909/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽⁸⁾ zugelassener Zentralverwahrer oder in einem Drittstaat niedergelassener Rechtsträger, der gemäß diesem Rechtsakt zugelassen oder registriert werden muss</p> <p>„UCIT“ = gemäß der Richtlinie 2009/65/EG des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽⁹⁾ zugelassener OGAW und seine Verwaltungsgesellschaft oder in einem Drittstaat niedergelassener Rechtsträger, der gemäß diesem Rechtsakt zugelassen oder registriert werden muss</p> |

| Nr. | Feld | Format |
|-----|--|---|
| | | <p>Taxonomie für nichtfinanzielle Gegenparteien. Die folgenden Kategorien entsprechen den Hauptabschnitten der NACE-Systematik gemäß der Verordnung (EG) Nr. 1893/2006 des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽¹⁰⁾</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 „T“ = Private Haushalte mit Hauspersonal; Herstellung von Waren und Erbringung von Dienstleistungen durch private Haushalte für den Eigenbedarf ohne ausgeprägten Schwerpunkt „U“ = Exterritoriale Organisationen und Körperschaften</p> |
| 6 | Zusätzliche Sektorzuordnung | <p>„ETFT“ = ETF „MMFT“ = MMF „REIT“ = REIT „OTHR“ = Sonstige</p> |
| 7 | Zweigniederlassung der meldenden Gegenpartei | ISO 3166-1 Alpha-2-Ländercode, zwei alphabetische Zeichen |
| 8 | Zweigniederlassung der anderen Gegenpartei | ISO 3166-1 Alpha-2-Ländercode, zwei alphabetische Zeichen |
| 9 | Seite der Gegenpartei | <p>„TAKE“ = Sicherungsnehmer „GIVE“ = Sicherungsgeber</p> |
| 10 | Für die Meldung zuständige Stelle | 20-stellige alphanumerische Rechtsträger-Kennung nach ISO 17442 (LEI-Code) |
| 11 | Andere Gegenpartei | 20-stellige alphanumerische Rechtsträger-Kennung nach ISO 17442 (LEI-Code) Kundenkennziffer (bis zu 50 alphanumerische Zeichen) |
| 12 | Land der anderen Gegenpartei | ISO 3166-1 Alpha-2-Ländercode, zwei alphabetische Zeichen |

| Nr. | Feld | Format |
|-----|---|--|
| 13 | Begünstigter | 20-stellige alphanumerische Rechtsträger-Kennung nach ISO 17442 (LEI-Code) Kundenkennziffer (bis zu 50 alphanumerische Zeichen) |
| 14 | Tri-Party-Agent | 20-stellige alphanumerische Rechtsträger-Kennung nach ISO 17442 (LEI-Code) |
| 15 | Makler | 20-stellige alphanumerische Rechtsträger-Kennung nach ISO 17442 (LEI-Code) |
| 16 | Clearingmitglied | 20-stellige alphanumerische Rechtsträger-Kennung nach ISO 17442 (LEI-Code) |
| 17 | Teilnehmender Zentralverwahrer oder indirekter Teilnehmer | 20-stellige alphanumerische Rechtsträger-Kennung nach ISO 17442 (LEI-Code) |
| 18 | Leihstelle | 20-stellige alphanumerische Rechtsträger-Kennung nach ISO 17442 (LEI-Code) |

- (¹) 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 (ABl. L 176 vom 27.6.2013, S. 338).
- (²) 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).
- (³) Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 15. Mai 2014 über Märkte für Finanzinstrumente (ABl. L 173 vom 12.6.2014, S. 349).
- (⁴) 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).
- (⁵) Richtlinie 2011/61/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 8. Juni 2011 über die Verwalter alternativer Investmentfonds, (ABl. L 174 vom 1.7.2011, S. 1).
- (⁶) Richtlinie 2003/41/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 3. Juni 2003 über die Tätigkeiten und die Beaufsichtigung von Einrichtungen der betrieblichen Altersversorgung (ABl. L 235 vom 23.9.2003, S. 10).
- (⁷) 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).
- (⁸) 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 (ABl. L 257 vom 28.8.2014, S. 1).
- (⁹) Richtlinie 2009/65/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 13. Juli 2009 zur Koordinierung der Rechts- und Verwaltungsvorschriften betreffen bestimmte Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) (ABl. L 302 vom 17.11.2009, S. 32).
- (¹⁰) 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 (ABl. L 393 vom 30.12.2006, S. 1).

Tabelle 2

Darlehen und Sicherheiten

| Nr. | Feld | Format |
|-----|--|--|
| 1 | Eindeutige Transaktionskennung (UTI) | Bis zu 52 alphanumerische Zeichen, einschließlich vier Sonderzeichen: Erlaubt sind ausschließlich die alphabetischen Großbuchstaben A–Z und die Zahlen 0–9, jeweils inklusive |
| 2 | Laufende Meldenummer | Bis zu 52 alphanumerische Zeichen, einschließlich vier Sonderzeichen: Erlaubt sind ausschließlich die alphabetischen Großbuchstaben A–Z und die Zahlen 0–9, jeweils inklusive |
| 3 | Datum des Ereignisses | Datum nach ISO 8601 (YYYY-MM-DD) |
| 4 | Art des Wertpapierfinanzierungs- geschäfts | „SLEB“ = Wertpapier- oder Warenverleih- oder -leihgeschäfte „SBSC“ = „Buy-sell back“- oder „Sell-buy back“-Geschäft „REPO“ = Pensionsgeschäft „MGLD“ = Lombardgeschäft |

| Nr. | Feld | Format |
|-----|------------------------------------|--|
| 5 | Gecleart | „true“ (zutreffend) „false“ (nicht zutreffend) |
| 6 | Clearing Zeitstempel | Datumsangabe nach ISO 8601, UTC-Zeit (koordinierte Weltzeit), d. h. (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ) |
| 7 | CCP | 20-stellige alphanumerische Rechtsträger-Kennung nach ISO 17442 (LEI-Code) |
| 8 | Handelsplatz | Handelsplatz-Identifikationsnummer (MIC) nach ISO 10383, vier alphanumerische Zeichen. Wenn es für einen Handelsplatz eine segmentäre MIC gibt, ist diese zu verwenden. |
| 9 | Art des Rahmenvertrags | „MRAA“ = MRA „GMRA“ = GMRA „MSLA“ = MSLA „GMSL“ = GMSLA „ISDA“ = ISDA „DERP“ = Deutscher Rahmenvertrag für Wertpapierpensionsgeschäfte „CNBR“ = China Bond Repurchase Master Agreement, „KRRR“ = Korea Financial Investment Association (KOFIA) Standard Repurchase Agreement „CARA“ = Investment Industry Regulatory Organization of Canada (IIROC) Repurchase/Reverse Repurchase Transaction Agreement „FRFB“ = Convention-Cadre Relative aux Operations de Pensions Livrees „CHRA“ = Swiss Master Repurchase Agreement „DEMA“ = German Master Agreement „JPBR“ = Japanese Master Agreement on the Transaction with Repurchase Agreement of the Bonds „ESRA“ = Contrato Marco de compraventa y Reporto de valores „OSLA“ = Overseas Securities Lending Agreement (OSLA) „MEFI“ = Master Equity and Fixed Interest Stock Lending Agreement (MEFISLA) „GESL“ = Gilt Edged Stock Lending Agreement (GESLA) „KRSL“ = Korean Securities Lending Agreement (KOSLA) „DERD“ = Deutscher Rahmenvertrag für Wertpapierdarlehen „AUSL“ = Australian Masters Securities Lending Agreement (AMSLA) „JPBL“ = Japanese Master Agreement on Lending Transaction of Bonds „JPSL“ = Japanese Master Agreement on the Borrowing and Lending Transactions of Share Certificates „BIAG“ = bilateraler Vertrag CSDA — bilateraler Vertrag zwischen Zentralverwahrern Oder „OTHR“ bei einem anderen Rahmenvertrag als den oben aufgeführten Verträgen |
| 10 | Andere Art von Rahmenvertrag | bis zu 50 alphanumerische Zeichen |
| 11 | Rahmenvertrag Version | Datumsangabe nach ISO 8601 (YYYY) |
| 12 | Ausführung Zeitstempel | Datumsangabe nach ISO 8601, UTC-Zeit (koordinierte Weltzeit), d. h. (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ) |
| 13 | Valutierungstermin (Anfangstermin) | Datum nach ISO 8601 (YYYY-MM-DD) |

| Nr. | Feld | Format |
|-----|--|--|
| 14 | Fälligkeitsdatum (Endtermin) | Datum nach ISO 8601 (YYYY-MM-DD) |
| 15 | Kontraktende | Datum nach ISO 8601 (YYYY-MM-DD) |
| 16 | Mindestkündigungsfrist | Feldnummer mit bis zu drei Zeichen |
| 17 | Frühester Call-back-Termin | Datum nach ISO 8601 (YYYY-MM-DD) |
| 18 | Allgemeiner Sicherheitenindikator | „SPEC“ = spezifische Sicherheit „GENE“ = allgemeine Sicherheit |
| 19 | DBV-Indikator (DBV = Delivery By Value) | „true“ (zutreffend) „false“ (nicht zutreffend) |
| 20 | Methode, nach der Sicherheiten bereitgestellt werden | „TTCA“ = Titeltransfer „SICA“ = Finanzsicherheiten „SIUR“ = Finanzsicherheiten mit Nutzungsrecht |
| 21 | Unbefristet | „true“ (zutreffend) „false“ (nicht zutreffend) |
| 22 | Kündigungsoptionen | „EGRN“ = unbegrenzt „ETSB“ = verlängerbar „NOAP“ = nicht zutreffend |

Bei Lombardkrediten sind die in den Feldern 23-34 aufgeführten Attribute für jede im Lombardkredit verwendete Währung anzugeben.

| | | |
|----|------------------------|--|
| 23 | Festsatz | Bis zu elf numerische Zeichen, einschließlich bis zu zehn Dezimalstellen, ausgedrückt als Prozentsatz, wobei 100 % als „100“ angegeben wird. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 24 | Zinsberechnungsmethode | Code für die Zinsberechnungsmethode: 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 Oder bis zu 35 alphanumerische Zeichen, wenn die Zinsberechnungsmethode oben nicht aufgeführt ist. |

| Nr. | Feld | Format |
|-----|---|--|
| 25 | Variabler Zinssatz | <p>Code für den Index, an dem sich der variable Satz orientiert</p> <p>„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</p> <p>Oder bis zu 25 alphanumerische Zeichen, wenn der Referenzsatz oben nicht aufgeführt ist.</p> |
| 26 | Referenzzeitraum für variablen Satz — Zeitraum | <p>Angabe des Referenzzeitraums unter Verwendung folgender Abkürzungen:</p> <p>„YEAR“ = Jahr „MNTH“ = Monat „WEEK“ = Woche „DAYS“ = Tag</p> |
| 27 | Referenzzeitraum für variablen Satz — Multiplikator | <p>Ganzzahliger Multiplikator des Zeitraums, der den Referenzzeitraum des variablen Satzes beschreibt.</p> <p>bis zu 3 Ziffern</p> |
| 28 | Zahlungshäufigkeit bei variablem Satz — Zeitraum | <p>Zeitraum, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten, wobei folgende Abkürzungen zu verwenden sind:</p> <p>„YEAR“ = Jahr „MNTH“ = Monat „WEEK“ = Woche „DAYS“ = Tag</p> |
| 29 | Zahlungshäufigkeit bei variablem Satz — Multiplikator | <p>Ganzzahliger Multiplikator des Zeitraums, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten.</p> <p>bis zu 3 Ziffern</p> |

| Nr. | Feld | Format |
|-----|--|--|
| 30 | Frequenz der Neufestsetzung bei variablem Satz — Zeitraum | Zeitraum, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien eine Neufestsetzung des variablen Repo-Satzes vornehmen, wobei folgende Abkürzungen gelten: „YEAR“ = Jahr „MNTH“ = Monat „WEEK“ = Woche „DAYS“ = Tag |
| 31 | Frequenz der Neufestsetzung bei variablem Satz — Multiplikator | Ganzzahliger Multiplikator des Zeitraums, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien eine Neufestsetzung des variablen Repo-Satzes vornehmen. bis zu 3 Ziffern |
| 32 | Spread | bis zu 5 Ziffern |
| 33 | Währungsbetrag Lombardkredite | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 34 | Währung Lombardkredite | Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |

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

| | | |
|----|-------------------------------------|--|
| 35 | Angepasster Satz | Bis zu elf numerische Zeichen, einschließlich bis zu zehn Dezimalstellen, ausgedrückt als Prozentsatz, wobei 100 % als „100“ angegeben wird. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 36 | Datum Zinssatz | Datum nach ISO 8601 (YYYY-MM-DD) |
| 37 | Kapitalbetrag am Valutierungstermin | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 38 | Kapitalbetrag am Fälligkeitstermin | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 39 | Währung Kapitalbetrag | Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |
| 40 | Art des Vermögenswerts | „SECU“ = Wertpapiere „COMM“ = Waren |
| 41 | Wertpapierkennung | ISIN nach ISO 6166 (12-stelliger alphanumerischer Code) |
| 42 | Wertpapierklassifizierung | CFI nach ISO 10692 (6-stelliger alphabetischer Code) |

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

| | | |
|----|--------------|--|
| 43 | Basisprodukt | Nur Eintragungen aus der Spalte „Basisprodukt“ der Tabelle zur Klassifizierung von Warenderivaten sind zulässig. |
|----|--------------|--|

| Nr. | Feld | Format |
|-----|--------------------------------|---|
| 44 | Unterprodukt | Nur Eintragungen aus der Spalte „Unterprodukt“ der Tabelle zur Klassifizierung von Warenderivaten sind zulässig. |
| 45 | Weiteres Unterprodukt | Nur Eintragungen aus der Spalte „Weiteres Unterprodukt“ der Tabelle zur Klassifikation von Warenderivaten sind zulässig. |
| 46 | Menge oder Nominalbetrag | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 47 | Maßeinheit | „KILO“ = Kilogram (Kilogramm), „PIEC“ = Piece (Stück), „TONS“ = Ton (Tonne), „METR“ = Metre (Meter), „INCH“ = Inch, „YARD“ = Yard, „GBGA“ = GBGallon (britische Gallone), „GRAM“ = Gram (Gramm), „CMET“ = Centimetre (Zentimeter), „SMET“ = SquareMetre (Quadratmeter), „FOOT“ = Foot (Fuß), „MILE“ = Mile (Meile), „SQIN“ = SquareInch (Quadratinch), „SQFO“ = SquareFoot (Quadratfuß), „SQMI“ = SquareMile (Quadratmeile), „GBOU“ = GBOunce (britische Unze), „USOU“ = USOunce (amerikanische Unze), „GBPI“ = GBPint (britisches Pint), „USPI“ = USPint (amerikanisches Pint), „GBQA“ = GBQuart (britisches Quart), „USQA“ = USQuart (amerikanisches Quart), „USGA“ = USGallon (amerikanische Gallone), „MMET“ = Millimetre (Millimeter), „KMET“ = Kilometre (Kilometer), „SQYA“ = SquareYard (Quadratyard), „ACRE“ = Acre, „ARES“ = Are (Ar), „SMIL“ = SquareMillimetre (Quadratmillimeter), „SCMT“ = SquareCentimetre (Quadratzentimeter), „HECT“ = Hectare (Hektar), „SQKI“ = SquareKilometre (Quadratkilometer), „MILI“ = MilliLitre (Milliliter), „CELI“ = Centilitre (Zentiliter), „LITR“ = Litre (Liter), „PUND“ = Pound (Pfund), „ALOW“ = Allowances, „ACCY“ = AmountOfCurrency (Währungsbetrag), „BARL“ = Barrel, „BCUF“ = BillionCubicFeet, „BDFT“ = BoardFeet, „BUSL“ = Bushel, „CEER“ = CertifiedEmissionsReduction (zertifizierte Emissionsenkung), „CLRT“ = ClimateReserveTonnes, „CBME“ = CubicMeters (Kubikmeter), „DAYS“ = Days (Tage), „DMET“ = DryMetricTons (Trocken-Metrische-Tonnen), „ENVC“ = EnvironmentalCredit (Umweltkredit), „ENVO“ = EnvironmentalOffset, „HUWG“ = Hundredweight (Zentner), „KWDC“ = KilowattDayCapacity (Kilowatttageskapazität), „KWHO“ = KilowattHours (Kilowattstunden), „KWHC“ = KilowattHoursCapacity (Kilowattstundenkapazität), „KMOC“ = KilowattMinuteCapacity (Kilowattminutenkapazität), „KWMC“ = KilowattMonthCapacity (Kilowattmonatskapazität), „KWYC“ = KilowattYearCapacity (Kilowattjahreskapazität), „MWDC“ = MegawattDayCapacity (Megawatttageskapazität), „MWHO“ = MegawattHours (Megawattstunden), „MWHC“ = MegawattHoursCapacity (Megawattstundenkapazität), „MWMC“ = MegawattMinuteCapacity (Megawattminutenkapazität), „MMOC“ = MegawattMonthCapacity (Megawattmonatskapazität), „MWYC“ = MegawattYearCapacity (Megawattjahreskapazität), „TONE“ = MetricTons (metrische Tonnen), „MBA“ = MillionBarrels (MillionenBarrel), „MBTU“ = OneMillionBTU (Mio. BTU), „OZTR“ = TroyOunces (Troy-Unzen), „UCWT“ = USHundredweight (amerikanischer Zentner), „IPNT“ = IndexPoint (Indexpunkt), „PWRD“ = PrincipalWithRelationToDebtInstrument (Kapitalbetrag in Relation zum Schuldeninstrument), „DGEU“ = DieselGallonEquivalent (Diesel-Gallone-Äquivalent), „GGEU“ = GasolineGallonEquivalent (Benzin-Gallone-Äquivalent), „TOCD“ = TonsofCarbonDioxide (Tonnen Kohlendioxid). |
| 48 | Währung des Nominalbetrags | Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |
| 49 | Wertpapier- oder Rohstoffpreis | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen, wenn der Preis in Einheiten ausgedrückt wird. Bis zu 11 numerische Zeichen einschließlich bis zu zehn Dezimalstellen, wenn der Preis als Prozentsatz oder Ertrag ausgedrückt wird. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 50 | Währung des Preises | Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |

| Nr. | Feld | Format |
|-----|------------------------------|---|
| 51 | Wertpapierqualität | „INVG“ = Investment-Grade „NINVG“ = Nicht-Investment-Grade „NOTR“ = ohne Rating „NOAP“ — nicht zutreffend |
| 52 | Fälligkeit des Wertpapiers | Datum nach ISO 8601 (YYYY-MM-DD) |
| 53 | Land des Emittenten | ISO 3166-1 Alpha-2-Ländercode, zwei alphabetische Zeichen |
| 54 | LEI des Emittenten | 20-stellige alphanumerische Rechtsträger-Kennung nach ISO 17442 (LEI-Code) |
| 55 | Art des Wertpapiers | „GOVS“ = Staatspapiere „SUNS“ = supranationale Wertpapiere und Wertpapiere von Agenturen „FIDE“ = Schuldverschreibungen (einschließlich gedeckter Schuldverschreibungen) von Banken und anderen Finanzinstituten „NFID“ = Unternehmensschuldverschreibungen (einschließlich gedeckter Schuldverschreibungen) von Nicht-Finanzinstituten „SEPR“ = verbriefte Produkte (einschließlich CDO, CMBS, ABCP) „MEQU“ = Hauptindex-Aktien (einschließlich Wandelschuldverschreibungen) „OEQU“ = sonstige Aktieninstrumente (einschließlich Wandelschuldverschreibungen) „OTHR“ = sonstige Vermögenswerte (einschließlich Anteilen an Investmentfonds) |
| 56 | Kreditbetrag | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 57 | Marktwert | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 58 | Verbilligter Satz (fest) | Bis zu elf numerische Zeichen, einschließlich bis zu zehn Dezimalstellen, ausgedrückt als Prozentsatz, wobei 100 % als „100“ angegeben wird. Ein etwaiges Minuszeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. |
| 59 | Verbilligter Satz (variabel) | Code für den Index, an dem sich der variable Satz orientiert „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 |

| Nr. | Feld | Format |
|-----|---|---|
| | | „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 Oder bis zu 25 alphanumerische Zeichen, wenn der Referenzsatz oben nicht aufgeführt ist. |
| 60 | Referenzzeitraum für variablen verbilligten Satz — Zeitraum | Angabe des Referenzzeitraums unter Verwendung folgender Abkürzungen: „YEAR“ = Jahr „MNTH“ = Monat „WEEK“ = Woche „DAYS“ = Tag |
| 61 | Referenzzeitraum für variablen verbilligten Satz — Multiplikator | Ganzzahliger Multiplikator des Zeitraums, der den Referenzzeitraum des variablen Satzes beschreibt. bis zu 3 Ziffern |
| 62 | Zahlungshäufigkeit beim variablen verbilligten Satz — Zeitraum | Zeitraum, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten, wobei folgende Abkürzungen zu verwenden sind: „YEAR“ = Jahr „MNTH“ = Monat „WEEK“ = Woche „DAYS“ = Tag |
| 63 | Zahlungshäufigkeit beim variablen verbilligten Satz — Multiplikator | Ganzzahliger Multiplikator des Zeitraums, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten. bis zu 3 Ziffern |
| 64 | Anpassungshäufigkeit beim variablen verbilligten Satz — Zeitraum | Zeitraum, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien eine Neufestsetzung des verbilligten variablen Satzes vornehmen, wobei folgende Abkürzungen gelten: „YEAR“ = Jahr „MNTH“ = Monat „WEEK“ = Woche „DAYS“ = Tag |
| 65 | Anpassungshäufigkeit beim variablen verbilligten Satz — Multiplikator | Ganzzahliger Multiplikator des Zeitraums, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien eine Neufestsetzung des verbilligten variablen Satzes vornehmen. bis zu 3 Ziffern |
| 66 | Spread des verbilligten Satzes | bis zu 5 Ziffern |
| 67 | Leihgebühr | Bis zu elf numerische Zeichen, einschließlich bis zu zehn Dezimalstellen, ausgedrückt als Prozentsatz, wobei 100 % als „100“ angegeben wird. |

| Nr. | Feld | Format |
|-----|--|---|
| 68 | Ausschließlichkeitsvereinbarungen | „true“ (zutreffend) „false“ (nicht zutreffend) |
| 69 | Ausstehender Lombardkredit | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 70 | Basiswährung des ausstehenden Lombardkredits | Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |
| 71 | Marktwert von Short-Positionen | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |

Sicherheiten

| | | |
|----|---|---|
| 72 | Signalisierung eines unbesicherten Wertpapierleihgeschäfts („SL“, Securities Lending) | „true“ (zutreffend) „false“ (nicht zutreffend) |
| 73 | Besicherung des Nettoforderungswerts | „true“ (zutreffend) „false“ (nicht zutreffend) |
| 74 | Valutierungstermin der Sicherheit(en) | Datum nach ISO 8601 (YYYY-MM-DD) |

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

| | | |
|----|--------------------------------|--|
| 75 | Art der Sicherheitenkomponente | „SECU“ = Wertpapiere „COMM“ = Waren (nur bei Repo-Geschäften, Wertpapier- oder Warenleih- und verleihgeschäften sowie „Buy-sell back“-Geschäften) „CASH“ = Bar |
|----|--------------------------------|--|

Wurden als Sicherheit Barmittel hinterlegt, ist dies in den Feldern 76 und 77 anzugeben.

| | | |
|----|---|---|
| 76 | Höhe Barsicherheit(en) | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 77 | Währung Barsicherheit(en) | Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |
| 78 | Kennung eines als Sicherheit hinterlegten Wertpapiers | ISIN nach ISO 6166 (12-stelliger alphanumerischer Code) |
| 79 | Klassifizierung eines als Sicherheit hinterlegten Wertpapiers | CFI nach ISO 10692 (6-stelliger alphabetischer Code) |

| Nr. | Feld | Format |
|--|---|---|
| Wurde eine Ware als Sicherheit hinterlegt, ist die Klassifizierung dieser Ware in den Feldern 80, 81 und 82 anzugeben. | | |
| 80 | Basisprodukt | Nur Eintragungen aus der Spalte „Basisprodukt“ der Tabelle zur Klassifizierung von Warenderivaten sind zulässig. |
| 81 | Unterprodukt | Nur Eintragungen aus der Spalte „Unterprodukt“ der Tabelle zur Klassifizierung von Warenderivaten sind zulässig. |
| 82 | Weiteres Unterprodukt | Nur Eintragungen aus der Spalte „Weiteres Unterprodukt“ der Tabelle zur Klassifikation von Warenderivaten sind zulässig. |
| 83 | Anzahl oder Nominalbetrag der Sicherheiten | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 84 | Maßeinheit der Sicherheit(en) | „KILO“ = Kilogram (Kilogramm), „PIEC“ = Piece (Stück), „TONS“ = Ton (Tonne), „METR“ = Metre (Meter), „INCH“ = Inch, „YARD“ = Yard, „GBGA“ = GBGallon (britische Gallone), „GRAM“ = Gram (Gramm), „CMET“ = Centimetre (Zentimeter), „SMET“ = SquareMetre (Quadratmeter), „FOOT“ = Foot (Fuß), „MILE“ = Mile (Meile), „SQIN“ = SquareInch (Quadratinch), „SQFO“ = SquareFoot (Quadratfuß), „SQMI“ = SquareMile (Quadratmeile), „GBOU“ = GBOunce (britische Unze), „USOU“ = USOunce (amerikanische Unze), „GBPI“ = GBPint (britisches Pint), „USPI“ = USPint (amerikanisches Pint), „GBQA“ = GBQuart (britisches Quart), „USQA“ = USQuart (amerikanisches Quart), „USGA“ = USGallon (amerikanische Gallone), „MMET“ = Millimetre (Millimeter), „KMET“ = Kilometre (Kilometer), „SQYA“ = SquareYard (Quadratyard), „ACRE“ = Acre, „ARES“ = Are (Ar), „SMIL“ = SquareMillimetre (Quadratmillimeter), „SCMT“ = SquareCentimetre (Quadratzentimeter), „HECT“ = Hectare (Hektar), „SQKI“ = SquareKilometre (Quadratkilometer), „MILI“ = MilliLitre (Milliliter), „CELI“ = Centilitre (Zentiliter), „LITR“ = Litre (Liter), „PUND“ = Pound (Pfund), „ALOW“ = Allowances, „ACCY“ = AmountOfCurrency (Währungsbetrag), „BARL“ = Barrel, „BCUF“ = BillionCubicFeet, „BDFT“ = BoardFeet, „BUSL“ = Bushel, „CEER“ = CertifiedEmissionsReduction (zertifizierte Emissionssenkung), „CLRT“ = ClimateReserveTonnes, „CBME“ = CubicMeters (Kubikmeter), „DAYS“ = Days (Tage), „DMET“ = DryMetricTons (Trocken-Metrische-Tonnen), „ENVC“ = EnvironmentalCredit (Umweltkredit), „ENVO“ = EnvironmentalOffset, „HUWG“ = Hundredweight (Zentner), „KWDC“ = KilowattDayCapacity (Kilowatttageskapazität), „KWHO“ = KilowattHours (Kilowattstunden), „KWHC“ = KilowattHoursCapacity (Kilowattstundenkapazität), „KMOC“ = KilowattMinuteCapacity (Kilowattminutenkapazität), „KWMC“ = KilowattMonthCapacity (Kilowattmonatskapazität), „KWYC“ = KilowattYearCapacity (Kilowattjahreskapazität), „MWDC“ = MegawattDayCapacity (Megawatttageskapazität), „MWHO“ = MegawattHours (Megawattstunden), „MWHC“ = MegawattHoursCapacity (Megawattstundenkapazität), „MWMC“ = MegawattMinuteCapacity (Megawattminutenkapazität), „MMOC“ = MegawattMonthCapacity (Megawattmonatskapazität), „MWYC“ = MegawattYearCapacity (Megawattjahreskapazität), „TONE“ = MetricTons (metrische Tonnen), „MIBA“ = MillionBarrels (MillionenBarrel), „MBTU“ = OneMillionBTU (Mio. BTU), „OZTR“ = TroyOunces (Troy-Unzen), „UCWT“ = USHundredweight (amerikanischer Zentner), „IPNT“ = IndexPoint (Indexpunkt), „PWRD“ = PrincipalWithRelationToDebtInstrument (Kapitalbetrag in Relation zum Schuldeninstrument), „DGEU“ = DieselGallonEquivalent (Diesel-Gallone-Äquivalent), „GGEU“ = GasolineGallonEquivalent (Benzin-Gallone-Äquivalent), „TOCD“ = TonsofCarbonDioxide (Tonnen Kohlendioxid). |
| 85 | Währung des Nominalbetrags der Sicherheit(en) | Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |
| 86 | Währung des Preises | Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |
| 87 | Preis pro Stück | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen, wenn der Preis in Einheiten ausgedrückt wird. Bis zu 11 numerische Zeichen einschließlich bis zu zehn Dezimalstellen, wenn der Preis als Prozentsatz oder Ertrag ausgedrückt wird. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |

| Nr. | Feld | Format |
|-----|---|---|
| 88 | Marktwert der Sicherheit(en) | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 89 | Abschlag oder Spanne | Bis zu elf numerische Zeichen, einschließlich bis zu zehn Dezimalstellen, ausgedrückt als Prozentsatz, wobei 100 % als „100“ angegeben wird. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 90 | Qualität der Sicherheit(en) | „INVG“ = Investment-Grade „NINVG“ = Nicht-Investment-Grade „NOTR“ = ohne Rating „NOAP“ = nicht zutreffend |
| 91 | Fälligkeitsdatum des Wertpapiers | Datum nach ISO 8601 (YYYY-MM-DD) |
| 92 | Land des Emittenten | ISO 3166-1 Alpha-2-Ländercode, zwei alphabetische Zeichen |
| 93 | LEI des Emittenten | 20-stellige alphanumerische Rechtsträger-Kennung nach ISO 17442 (LEI-Code) |
| 94 | Art der Sicherheit(en) | „GOVS“ = Staatspapiere „SUNS“ = supranationale Wertpapiere und Wertpapiere von Agenturen „FIDE“ = Schuldverschreibungen (einschließlich gedeckter Schuldverschreibungen) von Banken und anderen Finanzinstituten „NFID“ = Unternehmensschuldverschreibungen (einschließlich gedeckter Schuldverschreibungen) von Nicht-Finanzinstituten „SEPR“ = verbriefte Produkte (einschließlich CDO, CMBS, ABCP) „MEQU“ = Hauptindex-Aktien (einschließlich Wandelschuldverschreibungen) „OEUQ“ = sonstige Aktieninstrumente (einschließlich Wandelschuldverschreibungen) „OTHR“ = sonstige Vermögenswerte (einschließlich Anteilen an Investmentfonds) |
| 95 | Möglichkeit der Weiterverwendung einer Sicherheit | „true“ (zutreffend) „false“ (nicht zutreffend) |

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 | ISIN nach ISO 6166 (12-stelliger alphanumerischer Code) oder „NTAV“ |
| 97 | Portfolio-Code | 52 alphanumerische Zeichen, einschließlich vier Sonderzeichen: - _ . Am Anfang und am Ende des Codes sind Sonderzeichen nicht zulässig. Leerzeichen sind nicht zulässig. |
| 98 | Art des Vorgangs | „NEWT“ = Neu „MODI“ = Änderung „VALU“ = Bewertung „COLU“ = Aktualisierung der Sicherheiten „ERROR“ = Fehler „CORR“ = Korrektur |

| Nr. | Feld | Format |
|-----|-------|---|
| | | „ETRM“ = Kündigung/vorzeitige Kündigung „POSC“ = Positionskomponente |
| 99 | Ebene | „TCTN“ = Transaktion „PSTN“ = Position |

Tabelle 3

Angaben zu Einschuss-/Nachschusszahlungen

| Nr. | Feld | Format |
|-----|---|---|
| 1 | Meldezeitstempel | Datumsangabe nach ISO 8601, UTC-Zeit (koordinierte Weltzeit), d. h. (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ) |
| 2 | Datum des Ereignisses | Datum nach ISO 8601 (YYYY-MM-DD) |
| 3 | Meldung einreichende Stelle | 20-stellige alphanumerische Rechtsträger-Kennung nach ISO 17442 (LEI-Code) |
| 4 | Meldende Gegenpartei | 20-stellige alphanumerische Rechtsträger-Kennung nach ISO 17442 (LEI-Code) |
| 5 | Für die Meldung zuständige Stelle | 20-stellige alphanumerische Rechtsträger-Kennung nach ISO 17442 (LEI-Code) |
| 6 | Andere Gegenpartei | 20-stellige alphanumerische Rechtsträger-Kennung nach ISO 17442 (LEI-Code) |
| 7 | Portfolio-Code | 52 alphanumerische Zeichen, einschließlich vier Sonderzeichen: - _ . Am Anfang und am Ende des Codes sind Sonderzeichen nicht zulässig. Leerzeichen sind nicht zulässig. |
| 8 | Hinterlegte Ersteinschusszahlung | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 9 | Währung der hinterlegten Ersteinschusszahlung | Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |
| 10 | Hinterlegte Nachschusszahlung | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 11 | Währung der hinterlegten Nachschusszahlung | Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |
| 12 | Erhaltene Ersteinschusszahlung | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 13 | Währung der erhaltenen Ersteinschusszahlung | Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |
| 14 | Erhaltene Nachschusszahlung | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |

| Nr. | Feld | Format |
|-----|--|---|
| 15 | Währung der erhaltenen Nachschusszahlung | Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |
| 16 | Hinterlegte überschüssige Sicherheiten | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 17 | Währung der hinterlegten überschüssigen Sicherheiten | Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |
| 18 | Erhaltene überschüssige Sicherheiten | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 19 | Währung der erhaltenen überschüssigen Sicherheiten | Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |
| 20 | Art des Vorgangs | „NEWT“ = Neu „MARU“ = Aktualisierung der Einschuss-/Nachschusszahlungen „ERROR“ = Fehler „CORR“ = Korrektur |

Tabelle 4

Angaben zu Weiterverwendung, reinvestierten Barmitteln und Finanzierungsquellen

| Nr. | Feld | Format |
|-----|-----------------------------------|--|
| 1 | Meldezeitstempel | Datumsangabe nach ISO 8601, UTC-Zeit, d. h. (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ) |
| 2 | Datum des Ereignisses | Datum nach ISO 8601 (YYYY-MM-DD) |
| 3 | Meldung einreichende Stelle | 20-stellige alphanumerische Rechtsträger-Kennung nach ISO 17442 (LEI-Code) |
| 4 | Meldende Gegenpartei | 20-stellige alphanumerische Rechtsträger-Kennung nach ISO 17442 (LEI-Code) |
| 5 | Für die Meldung zuständige Stelle | 20-stellige alphanumerische Rechtsträger-Kennung nach ISO 17442 (LEI-Code) |

Feld 6 ist für jede Sicherheitenkomponente auszufüllen.

| | | |
|---|--------------------------------|--------------------------------------|
| 6 | Art der Sicherheitenkomponente | „SECU“ = Wertpapiere „CASH“ = Bar |
|---|--------------------------------|--------------------------------------|

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

| | | |
|---|--|---|
| 7 | Sicherheitenkomponente | ISIN nach ISO 6166 (12-stelliger alphanumerischer Code) |
| 8 | Wert weiterverwendeter Sicherheiten | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 9 | Geschätzte Weiterverwendung von Sicherheiten | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |

| Nr. | Feld | Format |
|--|--|---|
| 10 | Währung weiterverwendeter Sicherheiten | Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |
| 11 | Reinvestierungsquote | Bis zu elf numerische Zeichen, einschließlich bis zu zehn Dezimalstellen, ausgedrückt als Prozentsatz, wobei 100 % als „100“ angegeben wird. |
| Die Felder 12, 13 und 14 sind für jede Anlage, bei der Barsicherheiten reinvestiert wurden, und für jede Währung auszufüllen. | | |
| 12 | Art der reinvestierten Barinvestition | „MMFT“ = registrierter Geldmarktfonds „OCMP“ = sonstige zusammengelegte Pools „REPM“ = Repo-Markt „SDPU“ = Direktkauf von Wertpapieren „OTHR“ = Sonstige |
| 13 | Höhe reinvestierte Barmittel | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 14 | Währung reinvestierte Barmittel | Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |
| Bei Lombardgeschäften hat die Gegenpartei die Felder 15, 16 und 17 für jede Finanzierungsquelle erneut auszufüllen. Die Angaben müssen auf Unternehmensebene erfolgen. | | |
| 15 | Finanzierungsquellen | „REPO“ = Repos oder BSB „SECL“ = Barsicherheiten aus Wertpapierverleihgeschäften „FREE“ = freie Kredite „CSHS“ = Erträge aus Kunden-Leerverkäufen „BSHS“ = Erträge aus Makler-Leerverkäufen „UBOR“ = unbesicherte Leihgeschäfte „OTHR“ = Sonstige |
| 16 | Marktwert der Finanzierungsquellen | Bis zu 18 numerische Zeichen einschließlich bis zu fünf Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Wenn nicht möglich, Pro-Rata-Betrag. |
| 17 | Währung Finanzierungsquellen | Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |
| 18 | Art des Vorgangs | „NEWT“ = Neu „REUU“ = Aktualisierung der Weiterverwendung „ERROR“ = Fehler „CORR“ = Korrektur |

Tabelle 5

Klassifizierung von Waren

| Basisprodukt | Unterprodukt | Weiteres Unterprodukt |
|-----------------------|-----------------------------|---|
| „AGRI“ = Agrarprodukt | „GROS“ = Getreide, Ölsaaten | „FWHT“ = Futterweizen „SOYB“ = Sojabohnen „CORN“ = Mais „RPSD“ = Raps „RICE“ = Reis „OTHR“ = Sonstiges |

| Basisprodukt | Unterprodukt | Weiteres Unterprodukt |
|------------------|--|--|
| | „SOFT“ = Weichwaren | „CCOA“ = Kakao „ROBU“ = Robusta-Kaffee „WHSG“ = Weißzucker „BRWN“ = Rohzucker „OTHR“ = Sonstiges |
| | „POTA“ = Kartoffeln | |
| | „OOLI“ = Olivenöl | „LAMP“ = Lampantöl „OTHR“ = Sonstiges |
| | „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“ = Sonstiges |
| | „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 |

| Basisprodukt | Unterprodukt | Weiteres Unterprodukt |
|-----------------|---|---|
| | | „GSLN“ = Ottokraftstoff „HEAT“ = Heizöl „JTFL“ = Flugturbinenkraftstoff „KERO“ = Kerosin „LLSO“ = Light Louisiana Sweet (LLS) „MARS“ = MARS „NAPH“ = Naphtha „NGLO“ = NGL „TAPI“ = Tapis „URAL“ = Ural „WTIO“ = WTI „OTHR“ = Sonstiges |
| | „CO“ = Kohle „INRG“ = Arbitragegeschäft „RNNG“ = 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 | |

| Basisprodukt | Unterprodukt | Weiteres Unterprodukt |
|--|---|--|
| „INDP“ = Industrierzeugnisse | „CSTR“ = Baugewerbe/Bau „MFTG“ = Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren | |
| „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“ = Wellpappenroh papier „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 Abschnitt 10 Tabelle 10.1, der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583 der Kommission ⁽¹⁾ | | |
| „OTHR“ = Sonstiges | | |

⁽¹⁾ 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).

ANHANG II

Der Anhang der Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 wird durch den nachfolgenden Anhang ersetzt.

„ANHANG

Tabelle 1

Angaben zur Gegenpartei

| | Feld | Format |
|---|---|---|
| | Parteien | |
| 1 | Meldezeitstempel | Datumsangabe nach ISO 8601, UTC-Zeit (koordinierte Weltzeit) (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ). |
| 2 | ID der meldenden Gegenpartei | Kennziffer der juristischen Person (LEI) nach ISO 17442 (20-stelliger alphanumerischer Code) |
| 3 | Art der ID der anderen Gegenpartei | „LEI“: Kennziffer der juristischen Person (LEI) nach ISO 17442 „CLC“: Kundenkennziffer |
| 4 | ID der anderen Gegenpartei | Kennziffer der juristischen Person (LEI) nach ISO 17442 (20-stelliger alphanumerischer Code) Kundenkennziffer (bis zu 50 alphanumerische Zeichen). |
| 5 | Land der anderen Gegenpartei | Ländercode aus zwei Buchstaben nach ISO 3166 |
| 6 | Sparte, in der die meldende Gegenpartei tätig ist | <p>Taxonomie für finanzielle Gegenparteien:</p> <p>A = gemäß der Richtlinie 2009/138/EG des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽¹⁾ zugelassenes Versicherungsunternehmen</p> <p>C = gemäß der Richtlinie 2013/36/EU des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽²⁾ zugelassenes Kreditinstitut</p> <p>F = gemäß der Richtlinie 2004/39/EG des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽³⁾ zugelassene Wertpapierfirma</p> <p>I = gemäß der Richtlinie 2009/138/EC zugelassenes Versicherungsunternehmen</p> <p>L = alternativer Investmentfonds, der von einem gemäß der Richtlinie 2011/61/EU des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽⁴⁾ zugelassenen oder registrierten Verwalter alternativer Investmentfonds (AIFM) verwaltet wird</p> <p>O = Einrichtung der betrieblichen Altersversorgung im Sinne von Artikel 6 Buchstabe a der Richtlinie 2003/41/EG des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽⁵⁾</p> <p>R = gemäß der Richtlinie 2009/138/EG zugelassenes Rückversicherungsunternehmen</p> <p>U = gemäß der Richtlinie 2009/65/EG des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽⁶⁾ zugelassene Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) und ihre Verwaltungsgesellschaft</p> <p>Taxonomie für nichtfinanzielle Gegenparteien. Die folgenden Kategorien entsprechen den Hauptabschnitten der statistischen Systematik der Wirtschaftszweige in der Europäischen Gemeinschaft (NACE) gemäß der Verordnung (EG) Nr. 1893/2006 des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽⁷⁾.</p> <p>1 = Land- und Forstwirtschaft, Fischerei</p> <p>2 = Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden</p> <p>3 = verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren</p> <p>4 = Energieversorgung</p> |

| | Feld | Format |
|----|--|--|
| | | <p>5 = Wasserversorgung, Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen</p> <p>6 = Baugewerbe/Bau</p> <p>7 = Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen</p> <p>8 = Verkehr und Lagerei</p> <p>9 = Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie</p> <p>10 = Information und Kommunikation</p> <p>11 = Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen</p> <p>12 = Grundstücks- und Wohnungswesen</p> <p>13 = Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen</p> <p>14 = Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen</p> <p>15 = Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung</p> <p>16 = Erziehung und Unterricht</p> <p>17 = Gesundheits- und Sozialwesen</p> <p>18 = Kunst, Unterhaltung und Erholung</p> <p>19 = Erbringung von sonstigen Dienstleistungen</p> <p>20 = Private Haushalte mit Hauspersonal; Herstellung von Waren und Erbringung von Dienstleistungen durch private Haushalte für den Eigenbedarf ohne ausgeprägten Schwerpunkt</p> <p>21 = Exterritoriale Organisationen und Körperschaften</p> <p>Wird mehr als eine Tätigkeit gemeldet, sind die Codes in der Reihenfolge der relativen Bedeutung der betreffenden Tätigkeiten, getrennt durch einen Gedankenstrich („-“), aufzuführen.</p> <p>Im Falle von zentralen Gegenparteien und anderen Gegenparteien im Sinne von Artikel 1 Absatz 5 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 bleibt dieses Feld frei.</p> |
| 7 | Art der meldenden Gegenpartei | <p>F = finanzielle Gegenpartei</p> <p>N = nichtfinanzielle Gegenpartei</p> <p>C = zentrale Gegenpartei</p> <p>O = Sonstige</p> |
| 8 | Makler-ID | Kennziffer der juristischen Person (LEI) nach ISO 17442 (20-stelliger alphanumerischer Code) |
| 9 | ID der meldenden Stelle | Kennziffer der juristischen Person (LEI) nach ISO 17442 (20-stelliger alphanumerischer Code) |
| 10 | ID des Clearingmitglieds | Kennziffer der juristischen Person (LEI) nach ISO 17442 (20-stelliger alphanumerischer Code) |
| 11 | Art der ID des Begünstigten | <p>„LEI“: Kennziffer der juristischen Person (LEI) nach ISO 17442</p> <p>„CLC“: Kundenkennziffer</p> |
| 12 | ID des Begünstigten | Kennziffer der juristischen Person (LEI) nach ISO 17442 (20-stelliger alphanumerischer Code) oder Kundenkennziffer (bis zu 50 alphanumerische Zeichen), wenn der Kunde keine Kennziffer der juristischen Person erhalten kann |
| 13 | Eigenschaft, in der die Transaktion vollzogen wird | <p>P = Eigenhändler</p> <p>A = Beauftragter</p> |
| 14 | Seite der Gegenpartei | <p>B = Käufer</p> <p>S = Verkäufer</p> <p>Angabe gemäß Artikel 3a</p> |

| | Feld | Format |
|----|--|---|
| 15 | Direkte Verbindung zur Geschäftstätigkeit oder zum Liquiditäts- und Finanzmanagement | Y = Ja N = Nein |
| 16 | Clearingschwelle | Y = darüber N = darunter |
| 17 | Wert des Kontrakts | Bis zu 20 numerische Zeichen einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. |
| 18 | Währung, in der der Wert des Kontrakts angegeben ist | Währungscode nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |
| 19 | Bewertungszeitstempel | Datumsangabe nach ISO 8601, UTC-Zeit (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ) |
| 20 | Art der Bewertung | M = Marktpreisbewertung O = Modellpreisbewertung C = CCP-Bewertung |
| 21 | Besicherung | U = unbesichert PC = teilbesichert OC = einseitig besichert FC = vollständig besichert Angabe gemäß Artikel 3b |
| 22 | Besicherung auf Portfolioebene | Y = Ja N = Nein |
| 23 | Kennziffer des besicherten Portfolios | Bis zu 52 alphanumerische Zeichen, einschließlich vier Sonderzeichen: „., — _.“ Am Anfang und am Ende des Codes sind Sonderzeichen nicht zulässig. Leerzeichen sind nicht zulässig. |
| 24 | Hinterlegte Ersteinschusszahlung | Bis zu 20 numerische Zeichen einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 25 | Währung der hinterlegten Ersteinschusszahlung | Währungscode nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |
| 26 | Hinterlegte Nachschusszahlung | Bis zu 20 numerische Zeichen einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 27 | Währung der hinterlegten Nachschusszahlung | Währungscode nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |
| 28 | Erhaltene Ersteinschusszahlung | Bis zu 20 numerische Zeichen einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 29 | Währung der erhaltenen Ersteinschusszahlung | Währungscode nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |

| | Feld | Format |
|----|--|---|
| 30 | Erhaltene Nachschusszahlung | Bis zu 20 numerische Zeichen einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 31 | Währung der erhaltenen Nachschusszahlung | Währungscode nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |
| 32 | Hinterlegte überschüssige Sicherheiten | Bis zu 20 numerische Zeichen einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 33 | Währung der hinterlegten überschüssigen Sicherheiten | Währungscode nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |
| 34 | Erhaltene überschüssige Sicherheiten | Bis zu 20 numerische Zeichen einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. |
| 35 | Währung der erhaltenen überschüssigen Sicherheiten | Währungscode nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen |

- (1) 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).
- (2) 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).
- (3) Richtlinie 2004/39/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 21. April 2004 über Märkte für Finanzinstrumente, zur Änderung der Richtlinien 85/611/EWG und 93/6/EWG des Rates und der Richtlinie 2000/12/EG des Europäischen Parlaments und des Rates und zur Aufhebung der Richtlinie 93/22/EWG des Rates (ABl. L 145 vom 30.4.2004, S. 1).
- (4) 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).
- (5) Richtlinie 2003/41/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 3. Juni 2003 über die Tätigkeiten und die Beaufsichtigung von Einrichtungen der betrieblichen Altersversorgung (ABl. L 235 vom 23.9.2003, S. 10).
- (6) 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).
- (7) 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).

Tabelle 2

Allgemeine Angaben

| | Feld | Format | Derivatkontrakttypen |
|---|----------------------------------|--|----------------------|
| | Abschnitt 2a — Art des Kontrakts | | Alle Kontrakte |
| 1 | Art des Kontrakts | CD = finanzieller Differenzkontrakt FR = Zinstermingeschäft FU = Börsengehandelter Finanzterminkontrakt (Future) FW = Außerbörslicher Finanzterminkontrakt (Forward) OP = Option SB = Spreadbet SW = Swap ST = Tauschoption (Swaption) OT = Sonstige | |

| | Feld | Format | Derivatkontrakttypen |
|----|--|--|----------------------|
| 2 | Vermögensklasse | CO = Warenderivate und Derivate von Emissionszertifikaten CR = Kreditderivat CU = Währungsderivat EQ = Aktienderivat IR = Zinsderivat | |
| | Abschnitt 2b — Angaben zu den Kontrakten | | Alle Kontrakte |
| 3 | Art der Produktklassifizierung | C = CFI | |
| 4 | Produktklassifizierung | CFI nach ISO 10692, sechsstelliger alphabetischer Code | |
| 5 | Art der Produktkennung | Angabe des Identifikationstyps: I = ISIN A = AII | |
| 6 | Produktkennziffer | Produktkennung, Typ I: ISIN nach ISO 6166, 12-stelliger alphanumerischer Code Produktkennung, Typ A: Vollständiger AII-Code | |
| 7 | Art der Identifizierung der Basiswerte | I = ISIN A = AII B = Korb X = Index | |
| 8 | Identifizierung der Basiswerte | Identifizierung der Basiswerte, Typ I: ISIN nach ISO 6166, 12-stelliger alphanumerischer Code Identifizierung der Basiswerte, Typ A: vollständiger AII-Code Identifizierung der Basiswerte, Typ B: Identifizierung aller Bestandteile durch ISIN nach ISO 6166 oder den vollständigen AII-Code. Die Kennziffern der einzelnen Komponenten werden durch einen Bindestrich (-) getrennt. Identifizierung der Basiswerte, Typ X: sofern verfügbar, ISIN nach ISO 6166, andernfalls die vom Index-Anbieter zugewiesene vollständige Bezeichnung des Indexes | |
| 9 | Nennwährung 1 | Währungscode nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen | |
| 10 | Nennwährung 2 | Währungscode nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen | |
| 11 | Zu liefernde Währung | Währungscode nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen | |
| | Abschnitt 2c — Transaktionsdetails | | Alle Kontrakte |
| 12 | Transaktions-ID | Bis zu 52 alphanumerische Zeichen, einschließlich vier Sonderzeichen: „_ — .” Am Anfang und am Ende des Codes sind Sonderzeichen nicht zulässig. Leerzeichen sind nicht zulässig. | |

| | Feld | Format | Derivatkontrakttypen |
|----|---|---|----------------------|
| 13 | Laufende Meldenummer | Alphanumerisches Feld mit bis zu 52 Zeichen | |
| 14 | ID für Bestandteile eines komplexen Geschäfts | Alphanumerisches Feld mit bis zu 35 Zeichen | |
| 15 | Ausführungsplatz | Handelsplatz-Identifikationsnummer (MIC) nach ISO 10383, vier alphanumerische Zeichen, gemäß Artikel 4b. | |
| 16 | Zahlenmäßige Reduktion der ausstehenden Kontrakte („Compression“) | Y = aus einer solchen Reduktion hervorgegangener Kontrakt N = nicht aus einer solchen Reduktion hervorgegangener Kontrakt | |
| 17 | Preis/Satz | Bis zu 20 numerische Zeichen einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Wird der Preis als Prozentwert mitgeteilt, sollte er als Prozentsatz ausgedrückt werden, wobei 100 % als „100“ angegeben wird. | |
| 18 | Preisnotierung | U = Anteile P = Prozentsatz Y = Ertrag | |
| 19 | Währung, in der der Preis angegeben ist | Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen | |
| 20 | Nennwert | Bis zu 20 numerische Zeichen einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. | |
| 21 | Preismultiplikator | Bis zu 20 numerische Zeichen einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. | |
| 22 | Menge | Bis zu 20 numerische Zeichen einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. | |
| 23 | Zahlung bei Abschluss | Bis zu 20 numerische Zeichen einschließlich Dezimalstellen. Das negative Vorzeichen wird verwendet, wenn die Zahlung geleistet wurde, aber nicht eingegangen ist. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. | |

| | Feld | Format | Derivatkontrakttypen |
|----|--|---|----------------------|
| 24 | Art der Lieferung | C = Bar P = Physisch O = Optional für die Gegenpartei oder bei Festlegung durch einen Dritten | |
| 25 | Ausführungszeitstempel | Datumsangabe nach ISO 8601, UTC-Zeit (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ) | |
| 26 | Geltungsbeginn | Datum nach ISO 8601 (YYYY-MM-DD) | |
| 27 | Fälligkeitstermin | Datum nach ISO 8601 (YYYY-MM-DD) | |
| 28 | Kontraktende | Datum nach ISO 8601 (YYYY-MM-DD) | |
| 29 | Abrechnungstermin | Datum nach ISO 8601 (YYYY-MM-DD) | |
| 30 | Art des Rahmenvertrags | Freitextfeld mit maximal 50 Zeichen, gegebenenfalls mit Angabe des Namens des genutzten Rahmenvertrags | |
| 31 | Fassung des Rahmenvertrags | Datumsangabe nach ISO 8601 (YYYY) | |
| | Abschnitt 2d — Risikominderung/Meldung | | Alle Kontrakte |
| 32 | Bestätigungszeitstempel | Datumsangabe nach ISO 8601, UTC-Zeit (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ) | |
| 33 | Art der Bestätigung | Y = nichtelektronisch N = unbestätigt E = elektronisch | |
| | Abschnitt 2e — Clearing | | Alle Kontrakte |
| 34 | Clearingpflicht | Y = Ja N = Nein | |
| 35 | Gecleart | Y = Ja N = Nein | |
| 36 | Clearing-Zeitstempel | Datumsangabe nach ISO 8601, UTC-Zeit (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ) | |
| 37 | CCP | Kennziffer der juristischen Person (LEI) nach ISO 17442 20-stelliger alphanumerischer Code | |
| 38 | Gruppenintern | Y = Ja N = Nein | |
| | Abschnitt 2f — Zinssätze | | Zinsderivate |
| 39 | Fester Satz „Leg 1“ | Bis zu zehn numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen, ausgedrückt als Prozentsatz, wobei 100 % als „100“ angegeben wird. | |

| | Feld | Format | Derivatkontrakttypen |
|----|---|---|----------------------|
| | | Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. | |
| 40 | Festsatz, Leg 2 | Bis zu zehn numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen, ausgedrückt als Prozentsatz, wobei 100 % als „100“ angegeben wird. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. | |
| 41 | Festsatzberechnungsmethode „Leg 1“ | Zähler/Nenner, wobei Zähler und Nenner numerische Zeichen sind oder „Actual“ alphabetisch dargestellt wird, z. B. 30/360 oder Actual/365 | |
| 42 | Festsatzberechnungsmethode „Leg 2“ | Zähler/Nenner, wobei Zähler und Nenner numerische Zeichen sind oder „Actual“ alphabetisch dargestellt wird, z. B. 30/360 oder Actual/365 | |
| 43 | Zahlungsfrequenz Festzinsseite ‚Leg 1‘ — Zeitraum | Zeitraum, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten, wobei folgende Abkürzungen zu verwenden sind: Y = Jahr M = Monat W = Woche D = Tag | |
| 44 | Zahlungsfrequenz Festzinsseite Leg 1 — Multiplikator | Ganzzahliger Multiplikator des Zeitraums, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten. Bis zu drei numerische Zeichen | |
| 45 | Zahlungsfrequenz Festzinsseite „Leg 2“ — Zeitraum | Zeitraum, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten, wobei folgende Abkürzungen zu verwenden sind: Y = Jahr M = Monat W = Woche D = Tag | |
| 46 | Zahlungsfrequenz Festzinsseite „Leg 2“ — Multiplikator | Ganzzahliger Multiplikator des Zeitraums, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten. Bis zu drei numerische Zeichen | |
| 47 | Zahlungsfrequenz variable Seite „Leg 1“ — Zeitraum | Zeitraum, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten, wobei folgende Abkürzungen zu verwenden sind: Y = Jahr M = Monat W = Woche D = Tag | |
| 48 | Zahlungsfrequenz variable Seite „Leg 1“ — Multiplikator | Ganzzahliger Multiplikator des Zeitraums, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten. Bis zu drei numerische Zeichen | |

| | Feld | Format | Derivatkontrakttypen |
|----|--|---|----------------------|
| 49 | Zahlungsfrequenz variable Seite „Leg 2“ — Zeitraum | Zeitraum, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten, wobei folgende Abkürzungen zu verwenden sind: Y = Jahr M = Monat W = Woche D = Tag | |
| 50 | Zahlungsfrequenz variable Seite „Leg 2“ — Multiplikator | Ganzzahliger Multiplikator des Zeitraums, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten. Bis zu drei numerische Zeichen | |
| 51 | Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes „Leg 1“ — Zeitraum | Zeitraum, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien eine Neufestsetzung des variablen Satzes vornehmen, wobei folgende Abkürzungen gelten: Y = Jahr M = Monat W = Woche D = Tag | |
| 52 | Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes „Leg 1“ — Multiplikator | Ganzzahliger Multiplikator des Zeitraums, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien eine Neufestsetzung des variablen Satzes vornehmen. Bis zu drei numerische Zeichen | |
| 53 | Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes „Leg 2“ — Zeitraum | Zeitraum, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien eine Neufestsetzung des variablen Satzes vornehmen, wobei folgende Abkürzungen gelten: Y = Jahr M = Monat W = Woche D = Tag | |
| 54 | Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes „Leg 2“ — Multiplikator | Ganzzahliger Multiplikator des Zeitraums, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien eine Neufestsetzung des variablen Satzes vornehmen. Bis zu drei numerische Zeichen | |
| 55 | Variabler Satz „Leg 1“ | Bezeichnung des Indexes, an dem sich der variable Satz orientiert „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 | |

| | Feld | Format | Derivatkontrakttypen |
|----|---|---|----------------------|
| | | „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 Oder bis zu 25 alphanumerische Zeichen, wenn der Referenzsatz oben nicht aufgeführt ist | |
| 56 | Referenzzeitraum variable Seite „Leg 1“ — Zeitraum | Angabe des Referenzzeitraums unter Verwendung folgender Abkürzungen: Y = Jahr M = Monat W = Woche D = Tag | |
| 57 | Referenzzeitraum variable Seite „Leg 1“ — Multiplikator | Ganzzahliger Multiplikator des Zeitraums, der den Referenzzeitraum beschreibt. Bis zu drei numerische Zeichen | |
| 58 | Variabler Satz „Leg 2“ | Bezeichnung des Indexes, an dem sich der variable Satz orientiert „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 | |

| | Feld | Format | Derivatkontrakttypen |
|----|---|---|--|
| | | „TLBO“ = TELBOR „WIBO“ = WIBOR „TREA“ = Treasury „SWAP“ = SWAP „FUSW“ = Future SWAP Oder bis zu 25 alphanumerische Zeichen, wenn der Referenzsatz oben nicht aufgeführt ist | |
| 59 | Referenzzeitraum variable Seite „Leg 2“ — Zeitraum | Angabe des Referenzzeitraums unter Verwendung folgender Abkürzungen: Y = Jahr M = Monat W = Woche D = Tag | |
| 60 | Referenzzeitraum variable Seite „Leg 2“ — Multiplikator | Ganzzahliger Multiplikator des Zeitraums, der den Referenzzeitraum beschreibt. Bis zu drei numerische Zeichen | |
| | Abschnitt 2f — Devisen | | Währungsderivate |
| 61 | Zu liefernde Währung 2 | Währungskürzel nach ISO 4217, dreistelliger alphabetischer Code | |
| 62 | Wechselkurs 1 | Bis zu 10 numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. | |
| 63 | Devisenterminkurs | Bis zu 10 numerische Zeichen einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. | |
| 64 | Umrechnungsbasis | Zwei Währungscode nach ISO 4217, getrennt durch einen Schrägstrich (/). Der erste Währungscode gibt die Basiswährung, der zweite die quotierte Währung an. | |
| | Abschnitt 2h — Rohstoffe und Emissionszertifikate | | Warenderivate und Derivate von Emissionszertifikaten |
| | Allgemeines | | |
| 65 | Basiswert | AG = Agrarprodukt EN = Energie | |

| | Feld | Format | Derivatkontrakttypen |
|----|------------------------------------|--|----------------------|
| | | FR = Fracht ME = Metalle IN = Index EV = Umwelt EX = Exotisch OT = Sonstige | |
| 66 | Nähere Beschreibung des Basiswerts | <p><i>Agrarprodukt</i></p> GO = Getreide, Ölsaaten DA = Molkereiprodukte LI = Vieh FO = Forstwirtschaftliche Produkte SO = Weichwaren SF = Meeresfrüchte OT = Sonstige | |
| | | <p><i>Energie</i></p> OI = Öl NG = Erdgas CO = Kohle EL = Strom IE = Arbitragegeschäft OT = Sonstige | |
| | Energie | | |
| 67 | Lieferpunkt oder -zone | EIC-Code, 16-stelliger alphanumerischer Code. Wiederholbares Feld. | |
| 68 | Kuppelstelle/Kopplungspunkt | EIC-Code, 16-stelliger alphanumerischer Code. | |
| 69 | Art der Last | BL = Grundlast PL = Spitzenlast OP = Schwachlast BH = Stunde/Blockstunden SH = geformt („shaped“) GD = Gastag OT = Sonstige | |

| | Feld | Format | Derivatkontrakttypen |
|----|---|--|----------------------|
| | Wiederholbarer Abschnitt der Felder 70-77 | | |
| 70 | Lieferzeitspanne | hh:mmZ | |
| 71 | Lieferstarttermin und -zeit | Datumsangabe nach ISO 8601, UTC-Zeit (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ) | |
| 72 | Lieferendtermin und -zeit | Datumsangabe nach ISO 8601, UTC-Zeit (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ) | |
| 73 | Laufzeit | N = Minuten H = Stunde D = Tag W = Woche M = Monat Q = Quartal S = Saison Y = jährlich O = Sonstige | |
| 74 | Wochentage | WD = Werktag WN = Wochenende MO = Montag TU = Dienstag WE = Mittwoch TH = Donnerstag FR = Freitag SA = Samstag SU = Sonntag Es können mehrere, durch einen Schrägstrich (/) getrennte Werte angegeben werden. | |
| 75 | Lieferkapazität | 20 numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. | |
| 76 | Mengeneinheit | KW KWh/h KWh/d MW MWh/h MWh/d GW GWh/h GWh/d | |

| | Feld | Format | Derivatkontrakttypen |
|----|--|--|----------------------|
| | | Therm/d KTherm/d MTherm/d cm/d mcm/d | |
| 77 | Preis-/Zeitintervallmengen | Bis zu 20 numerische Zeichen einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. | |
| | Abschnitt 2i — Optionen | | Kontrakte mit Option |
| 78 | Art der Option | P = Put C = Call O = wenn nicht bestimmt werden kann, ob es sich um eine Call- oder Put-Option handelt | |
| 79 | Art der Option (mögliche Ausübung) | A = Amerikanische Option B = Bermuda-Option E = Europäische Option S = Asiatische Option Es können mehrere Angaben gemacht werden. | |
| 80 | Ausübungspreis (Zinsober-/untergrenze) | Bis zu 20 numerische Zeichen einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Wird der Ausübungspreis als Prozentwert mitgeteilt, sollte er als Prozentsatz ausgedrückt werden, wobei 100 % als „100“ angegeben wird. | |
| 81 | Notierung des Ausübungspreises | U = Anteile P = Prozentsatz Y = Ertrag | |
| 82 | Fälligkeit des Basiswerts | Datum nach ISO 8601 (YYYY-MM-DD) | |
| | Abschnitt 2j — Kreditderivate | | |
| 83 | Rang | SNDB = Vorrangig, z. B. vorrangige, unbesicherte Schuldtitel (Unternehmen/Finanzinstitute), Staatsschuldtitel in Fremdwährung (Regierungen) | |

| | Feld | Format | Derivatkontrakttypen |
|----|---|--|----------------------|
| | | SBOD = Nachrangig, z. B. nachrangige oder Lower-Tier-2-Schuldtitle (Banken), nachrangige (junior) oder Upper-Tier-2-Schuldtitle (Banken) OTHR = sonstige, z. B. Vorzugsaktien oder Kernkapital (Banken) oder andere Kreditderivate | |
| 84 | Referenzeinrichtung | Ländercode aus zwei Buchstaben nach ISO 3166 oder Ländercode aus zwei Buchstaben nach ISO 3166-2, gefolgt von einem Bindestrich (-) und einem Länderuntercode von bis zu drei alphanumerischen Zeichen oder Kennziffer der juristischen Person (LEI) nach ISO 17442 (20-stelliger alphanumerischer Code) | |
| 85 | Regelmäßigkeit der Zahlung | MNTH = monatlich QURT = vierteljährlich MIAN = halbjährlich YEAR = jährlich | |
| 86 | Berechnungsgrundlage | Zähler/Nenner, wobei Zähler und Nenner numerische Zeichen sind oder „Actual“ alphabetisch dargestellt wird, z. B. 30/360 oder Actual/365 | |
| 87 | Serien | Feldnummer mit bis zu fünf Zeichen | |
| 88 | Version | Feldnummer mit bis zu fünf Zeichen | |
| 89 | Indexfaktor | Bis zu 10 numerische Zeichen einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. | |
| 90 | Tranche | T = in Tranchen U = nicht in Tranchen | |
| 91 | Attachment-Point | Bis zu zehn numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen, ausgedrückt als Dezimalbruch zwischen 0 und 1. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. | |
| 92 | Detachment-Point | Bis zu zehn numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen, ausgedrückt als Dezimalbruch zwischen 0 und 1. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. | |
| | Abschnitt 2k — Änderung des Kontrakts | | |
| 93 | Art des Vorgangs | N = Neu M = Änderung | |

| | Feld | Format | Derivatkontrakttypen |
|----|-------|---|----------------------|
| | | E = Fehler C = vorzeitige Kündigung R = Korrektur Z = Reduktion V = Bewertungsaktualisierung P = Positionskomponente | |
| 94 | Ebene | T = Geschäft P = Position“ | |