Dieser Text dient lediglich zu Informationszwecken und hat keine Rechtswirkung. Die EU-Organe übernehmen keine Haftung für seinen Inhalt. Verbindliche Fassungen der betreffenden Rechtsakte einschließlich ihrer Präambeln sind nur die im Amtsblatt der Europäischen Union veröffentlichten und auf EUR-Lex verfügbaren Texte. Diese amtlichen Texte sind über die Links in diesem Dokument unmittelbar zugänglich

►B

DURCHFÜHRUNGSVERORDNUNG (EU) 2022/1860 DER KOMMISSION

vom 10. Juni 2022

zur Festlegung technischer Durchführungsstandards für die Anwendung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf die Standards, Formate, Häufigkeit und Methoden und Modalitäten für die Meldung

(Text von Bedeutung für den EWR)

(ABl. L 262 vom 7.10.2022, S. 68)

Berichtigt durch:

►C1 Berichtigung, ABl. L 304 vom 24.11.2022, S. 102 (2022/1860)
►C2 Berichtigung, ABl. L 125 vom 11.5.2023, S. 59 (2022/1860)

▼B

DURCHFÜHRUNGSVERORDNUNG (EU) 2022/1860 DER KOMMISSION

vom 10. Juni 2022

zur Festlegung technischer Durchführungsstandards für die Anwendung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf die Standards, Formate, Häufigkeit und Methoden und Modalitäten für die Meldung

(Text von Bedeutung für den EWR)

Artikel 1

Datenstandards und Formate von Meldungen über Derivate

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

Artikel 2

Häufigkeit der Meldungen

(1) Alle Meldungen der in Artikel 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1855 der Kommission [1] genannten Einzelheiten eines Derivats sind in der zeitlichen Reihenfolge zu übermitteln, in der die Ereignisse, die sich auf die zu meldenden Informationen beziehen, eingetreten sind.

(2) Eine CCP, eine finanzielle Gegenpartei oder eine nichtfinanzielle Gegenpartei im Sinne des Artikels 10 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012, die eine Gegenpartei eines Derivats ist, oder die für die Meldung zuständige Stelle meldet jede Änderung der Angaben zu den Sicherheiten in den Feldern 1 bis 29 Tabelle 3 des Anhangs der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1855 mit der Art des Vorgangs „Aktualisierung der Einschuss-/Nachschusszahlungen“ so, wie sie am Ende eines jeden Tages für das betreffende Derivat vorliegen, wenn:

a) das Derivat nicht fällig ist und nicht Gegenstand einer Meldung mit der Art des Vorgangs „Beendigung“, „Fehler“ oder „Positionskomponente“ gemäß Feld 151 der Tabelle 2 des Anhangs war oder

b) das Derivat Gegenstand einer Meldung mit der Art des Vorgangs „Wiederherstellung“ war, auf die keine weitere Meldung mit der Art des Vorgangs „Beendigung“ oder „Fehler“ gemäß Feld 151 der Tabelle 2 des Anhangs folgte.

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

▼B

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

Artikel 3

Identifizierung von Gegenparteien und anderen Stellen

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

a) eine Maklerfirma,

b) eine zentrale Gegenpartei,

c) ein Clearingmitglied,

d) eine Gegenpartei, bei der es sich um juristische Personen handelt,

e) eine die Meldung einreichende Stelle,

f) eine für die Meldung zuständige Stelle,

g) einen Anbieter von Diensten zur Verringerung von Nachhandelsrisiken.

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

Artikel 4

Richtung des Derivats

(1) Die in Tabelle 1 Feld 17 bis 19 des Anhangs genannte Seite der Gegenpartei eines Derivatekontrakts wird zum Zeitpunkt des Abschlusses des Derivats ►C1 gemäß den Absätzen 2 bis 13 ◄ bestimmt.

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

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

▼B

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

▼B

Artikel 5

Besicherung

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

a) als „unbesichert“, wenn die Gegenparteien keine Sicherungsvereinbarung geschlossen haben oder in der zwischen den Gegenparteien geschlossenen Sicherungsvereinbarung festgelegt ist, dass die Gegenparteien in Bezug auf das Derivat oder das Derivateportfolio weder den Ersteinschuss noch den Nachschuss hinterlegen.

b) als „teilbesichert: nur Gegenpartei 1“, wenn in der zwischen den Gegenparteien geschlossenen Sicherungsvereinbarung festgelegt ist, dass die meldende Gegenpartei nur regelmäßig Nachschusszahlungen leistet und dass die andere Gegenpartei in Bezug auf das Derivat oder das Derivateportfolio keine Einschusszahlungen leistet;

c) als „teilbesichert: nur Gegenpartei 2“, wenn in der zwischen den Gegenparteien geschlossenen Sicherungsvereinbarung festgelegt ist, dass die andere Gegenpartei nur regelmäßig Nachschüsse leistet und dass die meldende Gegenpartei in Bezug auf das Derivat oder das Derivateportfolio keine Einschusszahlungen leistet;

d) als „teilweise besichert“, wenn in der Sicherungsvereinbarung zwischen den Gegenparteien festgelegt ist, dass beide Gegenparteien nur regelmäßig Nachschüsse in Bezug auf das Derivat oder das Derivateportfolio leisten;

e) als „einseitig besichert: nur Gegenpartei 1“, wenn in der zwischen den Gegenparteien geschlossenen Sicherungsvereinbarung festgelegt ist, dass die meldende Gegenpartei die Ersteinschusszahlung und regelmäßige Nachschusszahlungen leistet und die andere Gegenpartei in Bezug auf das Derivat oder das Derivateportfolio keine Einschusszahlungen leistet;

f) als „einseitig besichert: nur Gegenpartei 2“, wenn in der zwischen den Gegenparteien geschlossenen Sicherungsvereinbarung festgelegt ist, dass die andere Gegenpartei die Ersteinschusszahlung und regelmäßige Nachschusszahlungen leistet und dass die meldende Gegenpartei in Bezug auf das Derivat oder das Derivateportfolio keine Einschusszahlungen leistet;

g) als „einseitig/teilbesichert: Gegenpartei 1“, wenn in der zwischen den Gegenparteien geschlossenen Sicherungsvereinbarung festgelegt ist, dass die meldende Gegenpartei die Ersteinschusszahlung und regelmäßige Nachschusszahlungen leistet und die andere Gegenpartei in Bezug auf das Derivat oder das Derivateportfolio regelmäßig nur Nachschusszahlungen leistet;

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

▼B

i) als „vollständig besichert“, wenn in der Sicherungsvereinbarung zwischen den Gegenparteien festgelegt ist, dass beide Gegenparteien in Bezug auf das Derivat oder das Derivateportfolio Einschusszahlungen und regelmäßig Nachschusszahlungen leisten.

Artikel 6

Spezifizierung, Identifizierung und Klassifizierung von Derivaten

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

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

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

a) es ist zum Handel zugelassen oder wird an einem Handelsplatz gehandelt;

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

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

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

Artikel 7

Eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer

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

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

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

▼B

a) bei geclearten Derivaten, bei denen es sich nicht um Derivate zwischen zwei CCPs handelt, wird die UTI beim Clearing durch die CCP für das Clearingmitglied generiert. Bei einer Transaktion, bei dem die CCP keine Gegenpartei ist, generiert das Clearingmitglied für seine Gegenpartei eine andere UTI;

b) bei zentral ausgeführten, aber nicht zentral geclearten Derivaten wird die UTI vom Ausführungsplatz für sein Mitglied generiert;

c) bei anderen als den unter den Buchstaben a und b genannten Derivaten, bei denen eine der Gegenparteien den Meldepflichten in einem Drittland unterliegt, wird die UTI gemäß den Vorschriften des Rechtsraums der Gegenpartei generiert, die diesen Meldepflichten zuerst nachkommen muss.

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

i) für Derivate, die auf elektronischem Wege zentral bestätigt wurden, die Bestätigungsplattform für die Transaktion zum Zeitpunkt der Bestätigung;

ii) bei allen anderen Derivaten einigen sich die Gegenparteien auf eine für die Generierung der UTI zuständige Stelle. Können die Gegenparteien keine Einigung erzielen, so ist diejenige Gegenpartei für die Generierung verantwortlich, deren LEI als erste auf der Sortierung der Kennungen der Gegenparteien in umgekehrter Folge der Zeichen der Kennung beruht.

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

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

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

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

▼B

d) bei anderen als den unter den Buchstaben a, b und c genannten Derivaten, die auf elektronischem Wege zentral bestätigt wurden, wird die UTI von der Bestätigungsplattform für die Transaktion zum Zeitpunkt der Bestätigung generiert;

e) für alle nicht unter den Buchstaben a bis d genannten Derivate gilt Folgendes:

i) schließen finanzielle Gegenparteien ein Derivat mit nichtfinanziellen Gegenparteien ab, wird die UTI von der finanziellen Gegenpartei generiert;

ii) bei Derivaten, die zwischen nichtfinanziellen Gegenparteien oberhalb der Clearingschwelle und nichtfinanziellen Gegenparteien unterhalb der Clearingschwelle geschlossen werden, wird die UTI durch die nichtfinanziellen Gegenparteien oberhalb der Clearingschwelle generiert;

iii) bei allen anderen Derivaten als den unter den Ziffern i und ii genannten vereinbaren die Gegenparteien die für die Generierung der UTI zuständige Stelle. Können die Gegenparteien keine Einigung erzielen, so ist diejenige Gegenpartei für die Generierung verantwortlich, deren LEI als erste auf der Sortierung der Kennungen der Gegenparteien in umgekehrter Folge der Zeichen der Kennung beruht.

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

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

Artikel 8

Meldung von LEI-Änderungen und Aktualisierung des Identifizierungscodes von LEI

(1) Wird die gemäß Artikel 3 in einer Derivatemeldung genannte Gegenpartei einer Unternehmensumstrukturierung unterzogen, die zu einer Änderung ihrer LEI führt, so unterrichtet diese Gegenpartei oder die Gegenpartei, zu der die neue LEI gehört, oder die Stelle, die für die Meldung im Namen einer dieser Gegenparteien gemäß Artikel 9 Absätze 1a bis 1d der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 zuständig ist, oder die Stelle, an die eine der Gegenparteien die Meldung gemäß Artikel 9 Absatz 1f der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 delegiert hat, das Transaktionsregister, dem die von der Unternehmensumstrukturierung betroffene Gegenpartei ihre Derivate gemeldet hat, über die Änderung und beantragt eine Aktualisierung der LEI in den betroffenen Derivaten gemäß Artikel 2 Absatz 2 Buchstaben a und b zum Zeitpunkt des Unternehmensumstrukturierungsereignisses, das zu einer Änderung der LEI oder der nach diesem Datum gemeldeten Kontrakte geführt hat.

▼B

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

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

a) die LEI jeder der an der Unternehmensumstrukturierung beteiligten Gegenparteien;

b) die LEI der neuen Gegenpartei;

c) das Datum, an dem die Änderung der LEI erfolgt oder erfolgt ist;

d) die UTI der betroffenen Derivate, wenn das Ereignis der Unternehmensumstrukturierung nur eine Untergruppe der in Artikel 2 Absatz 2 Buchstaben a und b genannten Derivate betrifft;

e) einen Nachweis, dass die Unternehmensumstrukturierung stattgefunden hat oder stattfinden soll, vorbehaltlich der Offenlegungsvorschriften für die Veröffentlichung von Insiderinformationen nach Artikel 17 der Verordnung (EU) Nr. 596/2014.

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

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

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

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

▼B

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

Artikel 9

Methoden und Modalitäten für die Meldung

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

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

b) jegliche Meldehindernisse, die die meldende Stelle davon abhalten, Meldungen innerhalb der in Artikel 9 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Frist an ein Transaktionsregister zu übermitteln,

c) alle wesentlichen Probleme, die zu Meldefehlern führen, die keine Ablehnung durch ein Transaktionsregister gemäß der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1858 der Kommission [2] zur Folge haben würden.

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

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

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

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

▼B

a) Vorkehrungen für die rechtzeitige Bereitstellung der folgenden Einzelheiten zu den OTC-Derivatekontrakten durch die nichtfinanzielle Gegenpartei, bei denen nicht davon ausgegangen werden kann, dass die finanzielle Gegenpartei über sie verfügt, und bei denen diese der finanziellen Gegenpartei unbekannt sind:

i) Makler-ID gemäß Feld 15 der Tabelle 1 des Anhangs,

ii) Clearingmitglied gemäß Feld 16 der Tabelle 1 des Anhangs,

iii) direkt in Verbindung mit ihrer Geschäftstätigkeit oder der Unternehmensfinanzierung gemäß Feld 20 der Tabelle 1 des Anhangs,

b) Vorkehrungen für die rechtzeitige Information der finanziellen Gegenpartei durch die nichtfinanzielle Gegenpartei über jede Änderung ihrer rechtlichen Verpflichtungen gemäß Artikel 10 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012,

c) Vorkehrungen für eine ordnungsgemäße Erneuerung ihrer LEI durch die nichtfinanzielle Gegenpartei im Einklang mit den Bedingungen einer der akkreditierten lokalen operativen Stelle des globalen LEI-Systems,

d) Vorkehrungen, nach denen die nichtfinanzielle Gegenpartei der finanziellen Gegenpartei rechtzeitig ihre Entscheidung mitteilt, mit der Meldung der Einzelheiten der mit der finanziellen Gegenpartei geschlossenen OTC-Derivatekontrakte zu beginnen oder diese zu nicht mehr durchzuführen. Diese Vorkehrungen sollen zumindest sicherstellen, dass die Meldung schriftlich oder in gleichwertiger Form auf elektronischem Wege mindestens zehn Arbeitstage vor dem Datum erfolgt, an dem die nichtfinanzielle Gegenpartei die Meldung beginnen oder einstellen möchte.

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

▼C2

Artikel 10

Zeitpunkt, bis zu dem Derivatekontrakte gemeldet werden müssen

Eine Gegenpartei eines Derivats, das die in Artikel 2 Absatz 2 Buchstabe a oder b genannten Bedingungen am 29. April 2024 erfüllt, oder die für die Meldung zuständige Stelle meldet alle gemäß dem Anhang erforderlichen Einzelheiten dieses Derivats, indem sie innerhalb von 180 Kalendertagen nach dem 29. April 2024 eine Meldung mit der Ereignisart „Aktualisierung“ übermittelt, es sei denn, sie hat innerhalb dieses Zeitraums eine Meldung mit Art des Vorgangs „Änderung“ oder „Korrektur“ für dieses Derivat vorgelegt.

▼B

Artikel 11

Aufhebung

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

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

Artikel 12

Inkrafttreten und Geltung

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

Sie gilt ab dem am 29. April 2024.

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

▼B

ANHANG

Tabelle 1

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

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
			„AIFD“ – ein alternativer Investmentfonds (AIF) im Sinne des Artikels 4 Absatz 1 Buchstabe a der Richtlinie 2011/61/EU des Europäischen Parlaments und des Rates ([6]), der entweder in der Union niedergelassen ist oder von einem gemäß der Richtlinie 2011/61/EU zugelassenen oder eingetragenen Verwalter alternativer Investmentfonds (AIFM) verwaltet wird, – es sei denn, der AIF wird ausschließlich zum Zweck der Durchführung eines oder mehrerer Mitarbeiteraktienkaufpläne eingerichtet oder der AIF ist eine Verbriefungszweckgesellschaft im Sinne des Artikels 2 Absatz 3 Buchstabe g der Richtlinie 2011/61/EU – sowie gegebenenfalls dessen in der Union niedergelassener AIFM; „CSDS“ – ein gemäß der Verordnung (EU) Nr. 909/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates ([7]) zugelassener Zentralverwahrer; 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 ([8]): „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

▼B

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

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
12	Parteien des Derivats	Unternehmenssektor der Gegenpartei 2	Taxonomie für finanzielle Gegenparteien: „INVF“ – eine gemäß der Richtlinie 2014/65/EU zugelassene Wertpapierfirma „CDTI“ – ein gemäß der Richtlinie 2013/36/EU zugelassenes Kreditinstitut „INUN“ – ein gemäß der Richtlinie 2009/138/EG zugelassenes Versicherungsunternehmen oder Rückversicherungsunternehmen „UCIT“ – ein gemäß der Richtlinie 2009/65/EG zugelassener OGAW und gegebenenfalls dessen Verwaltungsgesellschaft, es sei denn, der OGAW wird ausschließlich zum Zweck der Durchführung eines oder mehrerer Mitarbeiteraktienkaufpläne eingerichtet „ORPI“ – eine Einrichtung der betrieblichen Altersversorgung (EbAV) im Sinne des Artikels 6 Nummer 1 der Richtlinie (EU) 2016/2341 „AIFD“ – ein alternativer Investmentfonds (AIF) im Sinne des Artikels 4 Absatz 1 Buchstabe a der Richtlinie 2011/61/EU, der entweder in der Union niedergelassen ist oder von einem gemäß dieser Richtlinie zugelassenen oder eingetragenen Verwalter alternativer Investmentfonds (AIFM) verwaltet wird, – es sei denn, der AIF wird ausschließlich zum Zweck der Durchführung eines oder mehrerer Mitarbeiteraktienkaufpläne eingerichtet oder der AIF ist eine Verbriefungszweckgesellschaft im Sinne des Artikels 2 Absatz 3 Buchstabe g der Richtlinie 2011/61/EU – sowie gegebenenfalls dessen in der Union niedergelassener AIFM „CSDS“ – ein gemäß der Verordnung (EU) Nr. 909/2014 zugelassener Zentralverwahrer Taxonomie für nichtfinanzielle Gegenparteien. Die folgenden Kategorien entsprechen den Hauptabschnitten der NACE-Systematik gemäß der Verordnung (EG) Nr. 1893/2006: „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

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
			„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 Wird mehr als eine Tätigkeit gemeldet, sind die Codes in der Reihenfolge der relativen Bedeutung der betreffenden Tätigkeiten aufzuführen. Im Falle von CCPs und anderen Gegenparteien im Sinne des Artikels 1 Absatz 5 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 bleibt dieses Feld frei.
13	Parteien des Derivats	Clearingschwelle der Gegenpartei 2	Boolescher Wert: TRUE = darüber FALSE = darunter
14	Parteien des Derivats	Meldepflicht der Gegenpartei 2	Boolescher Wert: — TRUE, wenn die Meldepflicht bei der Gegenpartei 2 liegt — FALSE, wenn die Meldepflicht nicht bei der Gegenpartei 2 liegt
15	Parteien des Derivats	Makler-ID	Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20 alphanumerische Zeichen, die in den von der Global LEI Foundation veröffentlichten LEI-Daten enthalten sind.
16	Parteien des Derivats	Clearingmitglied	Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20 alphanumerische Zeichen, die in den von der Global LEI Foundation veröffentlichten LEI-Daten enthalten sind.
17	Parteien des Derivats	Richtung	Vier Buchstaben: BYER = Käufer SLLR = Verkäufer Gemäß Artikel 4 der vorliegenden Verordnung einzutragen.

▼B

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

([1]) Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 15. Mai 2014 über Märkte für Finanzinstrumente sowie zur Änderung der Richtlinien 2002/92/EG und 2011/61/EU (ABl. L 173 vom 12.6.2014, S. 349).
([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 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).
([4]) 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).
([5]) Richtlinie (EU) 2016/2341 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 14. Dezember 2016 über die Tätigkeiten und die Beaufsichtigung von Einrichtungen der betrieblichen Altersversorgung (EbAV) (ABl. L 354 vom 23.12.2016, S. 37).
([6]) 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).
([7]) Verordnung (EU) Nr. 909/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 23. Juli 2014 zur Verbesserung der Wertpapierlieferungen und -abrechnungen in der Europäischen Union und über Zentralverwahrer sowie zur Änderung der Richtlinien 98/26/EG und 2014/65/EU und der Verordnung (EU) Nr. 236/2012 (ABl. L 257 vom 28.8.2014, S. 1).
([8]) 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).
([9]) Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. Juli 2012 über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister (ABl. L 201 vom 27.7.2012, S. 1).

Tabelle 2

	Abschnitt	Feld	Format
1	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	UTI	UTI nach ISO 23897 Bis zu 52 alphanumerische Zeichen, wobei nur die Großbuchstaben A–Z und die Ziffern 0–9 zulässig sind
2	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	Laufende Meldenummer	Alphanumerisches Feld mit bis zu 52 Zeichen
3	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	Vorherige UTI (für „one-to-one"- und „one-to-many"-Beziehungen zwischen Transaktionen)	Bis zu 52 alphanumerische Zeichen, wobei nur die Großbuchstaben A–Z und die Ziffern 0–9 zulässig sind

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
4	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	UTI der späteren Position	Bis zu 52 alphanumerische Zeichen, wobei nur die Großbuchstaben A–Z und die Ziffern 0–9 zulässig sind
5	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	ID des Dienstes zur Verringerung von Nachhandelsrisiken (PTRR)	Bis zu 52 alphanumerische Zeichen, wobei nur die Großbuchstaben A–Z und die Ziffern 0–9 zulässig sind. Die ersten 20 Zeichen stellen die LEI des Komprimierungsanbieters dar.
6	Abschnitt 2a – Kennungen und Links	Kennung des Pakets	Bis zu 35 alphanumerische Zeichen.
7	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Internationale Wertpapier-Identifikationsnummer (ISIN)	ISIN nach ISO 6166, 12-stelliger alphanumerischer Code
8	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Eindeutige Produktkennung (UPI)	UPI nach ISO 4914, 12-stelliger alphanumerischer Code
9	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Produktklassifizierung	CFI nach ISO 10962, 6-stelliger alphabetischer Code
10	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Art des Kontrakts	CFDS = finanzieller Differenzkontrakt FRAS = Zinstermingeschäft FUTR = Börsengehandelter Finanzterminkontrakt (Future) FORW= Außerbörslicher Finanzterminkontrakt (Forward) OPTN = Option SPDB = Spreadbet SWAP = Swap SWPT = Tauschoption (Swaption) OTHR = Sonstige
11	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Kategorie von Vermögenswerten	COMM = Warenderivate und Derivate von Emissionszertifikaten CRDT = Kreditderivat CURR = Währungsderivat EQUI = Aktienderivat INTR = Zinsderivat
12	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Derivat auf Basis von Kryptoanlagen	Boolescher Wert: — TRUE – für Derivate auf Basis von Kryptoanlagen — FALSE – für andere Derivate
13	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Art der Identifizierung der Basiswerte	1 Buchstabe: I = ISIN B = Korb X = Index

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
14	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Identifizierung der Basiswerte	Identifizierung der Basiswerte, Typ I: ISIN nach ISO 6166, 12-stelliger alphanumerischer Code Identifizierung der Basiswerte, Typ X: sofern verfügbar ISIN nach ISO 6166, 12-stelliger alphanumerischer Code
15	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Indikator des Basisindexes	Angabe des Indexes des variablen Zinssatzes. Vier Buchstaben: ESTR = EURSTR SONA = SONIA SOFR = SOFR EONA = EONIA EONS = EONIA SWAP EURI = EURIBOR EUUS = EURODOLLAR EUCH = EuroSwiss GCFR = GCF REPO ISDA = ISDAFIX LIBI = LIBID LIBO = LIBOR MAAA = Muni AAA PFAN = Pfandbriefe TIBO = TIBOR STBO = STIBOR BBSW = BBSW JIBA = JIBAR BUBO = BUBOR CDOR = CDOR CIBO = CIBOR MOSP = MOSPRIM NIBO = NIBOR PRBO = PRIBOR TLBO = TELBOR WIBO = WIBOR TREA = Treasury SWAP = SWAP FUSW = Future SWAP EFFR = effektiver Leitzins der US-Notenbank OBFR = Overnight Bank Funding Rate CZNA = CZEONIA
16	Abschnitt 2b – Angaben zu den Kontrakten	Name des Basisindexes	Bis zu 50 alphanumerische Zeichen. Sonderzeichen sind zulässig, wenn sie zum vollständigen Namen des Indexes gehören.

▼B

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

▼B

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

▼B

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

▼B

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

▼B

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

▼B

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

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
64	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennbetrag von Leg 2	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an. Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
65	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennwährung 2	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
	Die Felder 66 bis 68 sind wiederholbar und bei Derivaten mit Listen von Nennbeträgen auszufüllen.		
66	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Geltungsbeginn des Nennbetrags von Leg 2	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
67	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Endtermin des Nennbetrags von Leg 2	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
68	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennbetrag, der ab dem zugehörigen Geltungsbeginn von Leg 2 gilt	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an. Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
69	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Gesamte Nennmenge von Leg 2	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an. Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
	Die Felder 70 bis 72 sind wiederholbar und bei Derivaten mit Listen von Nennmengen auszufüllen.		

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
70	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Geltungsbeginn der Nennmenge von Leg 2	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
71	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Endtermin der Nennmenge von Leg 2	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
72	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Nennmenge, die ab dem zugehörigen Geltungsbeginn von Leg 2 gilt	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an. Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
	Der Abschnitt der Felder 73 bis 78 ist wiederholbar		
73	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Sonstige Art der Zahlung	Vier Buchstaben: UFRO = Abschlagszahlung, d. h. die erste Zahlung einer der Gegenparteien, um eine Transaktion entweder auf den beizulegenden Zeitwert zu bringen oder aus einem anderen Grund, der hinter einer außerbörslichen Transaktion stehen kann UWIN = Auslaufen oder vollständige Beendigung, d. h. die Abschlusszahlung, wenn eine Transaktion vor ihrem Endtermin ausläuft; Zahlungen aufgrund der vollständigen Beendigung von Derivategeschäften PEXH = wichtigster Austausch, d. h. Austausch von Nennwerten für „Cross-Currency Swaps“
74	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Sonstiger Zahlungsbetrag	Bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an. Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Jeder Wert größer oder gleich Null ist zulässig.
75	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Sonstige Zahlungswährung	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
76	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Sonstiger Zahlungstermin	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
77	Abschnitt 2g – Transaktionsdetails	Sonstiger Zahler	— Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20 alphanumerische Zeichen, die in den von der Global LEI Foundation veröffentlichten LEI-Daten enthalten sind, oder bis zu 72 alphanumerische Zeichen für natürliche Personen, die als Privatpersonen handeln und gemäß der „ROC-Erklärung“ keine LEI für sich beanspruchen können. Der Code zur Identifizierung einer natürlichen Person setzt sich aus der LEI der Gegenpartei 1 zusammen, gefolgt von einer eindeutigen Kennung, die dieser/diesen natürliche(n) Person(en) zu aufsichtsrechtlichen Meldezwecken von der Gegenpartei 1 zugewiesen und beibehalten wird.
78	Abschnitt 2g– Transaktionsdetails	Sonstiger Zahlungsempfänger	— Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20 alphanumerische Zeichen, die in den von der Global LEI Foundation veröffentlichten LEI-Daten enthalten sind, oder bis zu 72 alphanumerische Zeichen für natürliche Personen, die als Privatpersonen handeln und gemäß der „ROC-Erklärung“ keine LEI für sich beanspruchen können. Der Code zur Identifizierung einer natürlichen Person setzt sich aus der LEI der Gegenpartei 1 zusammen, gefolgt von einer eindeutigen Kennung, die dieser/diesen natürliche(n) Person(en) zu aufsichtsrechtlichen Meldezwecken von der Gegenpartei 1 zugewiesen und beibehalten wird.
79	Abschnitt 2h – Zinssätze	Festsatz Leg 1 oder Kupon	Positiver und negativer Wert, ausgedrückt als Prozentsatz mit bis zu elf numerischen Zeichen, die bis zu zehn Dezimalstellen umfassen (z. B. 2.57 statt 2,57 %). Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.
80	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zinsberechnungsmethode für den Festsatz oder Kupon Leg 1	Vier alphanumerische Zeichen: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule

▼B

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

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
			TIBO = TIBOR STBO = STIBOR BBSW = BBSW JIBA = JIBAR BUBO = BUBOR CDOR = CDOR CIBO = CIBOR MOSP = MOSPRIM NIBO = NIBOR PRBO = PRIBOR TLBO = TELBOR WIBO = WIBOR TREA = Treasury SWAP = SWAP FUSW = Future SWAP EFFR = effektiver Leitzins der US-Notenbank OBFR = Overnight Bank Funding Rate CZNA = CZEONIA
85	Abschnitt 2h – Zinssätze	Name des variablen Zinssatzes von Leg 1	Bis zu 50 alphanumerische Zeichen. Sonderzeichen sind zulässig, wenn sie zum vollständigen Namen des Indexes gehören.
86	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zinsberechnungs-methode für den variablen Zinssatz von Leg 1	Vier alphanumerische Zeichen: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
			A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = Meldebogen
87	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zahlungsfrequenz des variablen Zinssatzes von Leg 1	Vier Buchstaben: DAIL = täglich WEEK = wöchentlich MNTH = monatlich YEAR = jährlich ADHO = ad hoc bei unregelmäßigen Zahlungen EXPI = Zahlung bei Fälligkeit
88	Abschnitt 2h – Zinssätze	Multiplikator der Zahlungsfrequenz des variablen Zinssatzes von Leg 1	Ein ganzzahliger Wert größer oder gleich Null, bis zu drei numerische Zeichen
89	Abschnitt 2h – Zinssätze	Referenzzeitraum variable Seite Leg 1 – Zeitraum	Vier Buchstaben: DAIL = täglich WEEK = wöchentlich MNTH = monatlich YEAR = jährlich ADHO = ad hoc bei unregelmäßigen Zahlungen EXPI = Zahlung bei Fälligkeit
90	Abschnitt 2h – Zinssätze	Referenzzeitraum variable Seite Leg 1 – Multiplikator	Ein ganzzahliger Wert größer oder gleich Null, bis zu drei numerische Zeichen
91	Abschnitt 2h – Zinssätze	Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes Leg 1 – Zeitraum	Vier Buchstaben: DAIL = täglich WEEK = wöchentlich MNTH = monatlich YEAR = jährlich ADHO = ad hoc bei unregelmäßigen Zahlungen EXPI = Zahlung bei Fälligkeit
92	Abschnitt 2h – Zinssätze	Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes Leg 1 – Multiplikator	Ein ganzzahliger Wert größer oder gleich Null, bis zu drei numerische Zeichen

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
93	Abschnitt 2h – Zinssätze	Spread von Leg 1	— Wird der Spread als monetärer Wert mitgeteilt – ein Wert mit bis zu 18 numerischen Zeichen, der bis zu 13 Dezimalstellen umfasst. — Wird der Spread als Prozentwert mitgeteilt – ein Wert mit bis zu elf numerischen Zeichen, die bis zu zehn Dezimalstellen umfassen, ausgedrückt als Prozentsatz (z. B. 2.57 statt 2,57 %). — Wenn der Spread als Basispunkte mitgeteilt wird – ein ganzzahliger Wert mit bis zu fünf numerischen Zeichen, ausgedrückt als Basispunkte (z. B. 257 statt 2,57 %).
94	Abschnitt 2h – Zinssätze	Währung des Spreads von Leg 1	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
95	Abschnitt 2h – Zinssätze	Festsatz von Leg 2	Positiver und negativer Wert, ausgedrückt als Prozentsatz mit bis zu elf numerischen Zeichen, die bis zu zehn Dezimalstellen umfassen (z. B. 2.57 statt 2,57 %). Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.
96	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zinsberechnungsmethode Festsatz von Leg 2	Vier alphanumerische Zeichen: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = Meldebogen

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
97	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zahlungsfrequenz Festzinsseite Leg 2	Vier Buchstaben: DAIL = täglich WEEK = wöchentlich MNTH = monatlich YEAR = jährlich ADHO = ad hoc bei unregelmäßigen Zahlungen EXPI = Zahlung bei Fälligkeit
98	Abschnitt 2h – Zinssätze	Multiplikator der Zahlungsfrequenz Festzinsseite von Leg 2	Ein ganzzahliger Wert größer oder gleich Null, bis zu drei numerische Zeichen
99	Abschnitt 2h – Zinssätze	Kennung des variablen Zinssatzes von Leg 2	Wenn der variable Zinssatz eine ISIN hat, ist der ISIN-Code für diesen Zinssatz anzugeben.
100	Abschnitt 2h – Zinssätze	Angabe des variablen Zinssatzes von Leg 2	Angabe des Indexes des variablen Zinssatzes. Vier Buchstaben: ESTR = EURSTR SONA = SONIA SOFR = SOFR EONA = EONIA EONS = EONIA SWAP EURI = EURIBOR EUUS = EURODOLLAR EUCH = EuroSwiss GCFR = GCF REPO ISDA = ISDAFIX LIBI = LIBID LIBO = LIBOR MAAA = Muni AAA PFAN = Pfandbriefe TIBO = TIBOR STBO = STIBOR BBSW = BBSW JIBA = JIBAR BUBO = BUBOR CDOR = CDOR CIBO = CIBOR MOSP = MOSPRIM NIBO = NIBOR PRBO = PRIBOR TLBO = TELBOR

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
			WIBO = WIBOR TREA = Treasury SWAP = SWAP FUSW = Future SWAP EFFR = effektiver Leitzins der US-Notenbank OBFR = Overnight Bank Funding Rate CZNA = CZEONIA
101	Abschnitt 2h – Zinssätze	Name des variablen Zinssatzes von Leg 2	Bis zu 50 alphanumerische Zeichen. Sonderzeichen sind zulässig, wenn sie zum vollständigen Namen des Indexes gehören.
102	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zinsberechnungsmethode für den variablen Zinssatz von Leg 2	Vier alphanumerische Zeichen: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = Meldebogen
103	Abschnitt 2h – Zinssätze	Zahlungsfrequenz des variablen Zinssatzes von Leg 2	Vier Buchstaben: DAIL = täglich WEEK = wöchentlich MNTH = monatlich YEAR = jährlich ADHO = ad hoc bei unregelmäßigen Zahlungen EXPI = Zahlung bei Fälligkeit

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
104	Abschnitt 2h – Zinssätze	Multiplikator der Zahlungsfrequenz des variablen Zinssatzes von Leg 2	Ein ganzzahliger Wert größer oder gleich Null, bis zu drei numerische Zeichen
105	Abschnitt 2h – Zinssätze	Referenzzeitraum variable Seite Leg 2 – Zeitraum	Vier Buchstaben: DAIL = täglich WEEK = wöchentlich MNTH = monatlich YEAR = jährlich ADHO = ad hoc bei unregelmäßigen Zahlungen EXPI = Zahlung bei Fälligkeit
106	Abschnitt 2h – Zinssätze	Referenzzeitraum variable Seite Leg 2 – Multiplikator	Ein ganzzahliger Wert größer oder gleich Null, bis zu drei numerische Zeichen
107	Abschnitt 2h – Zinssätze	Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes Leg 2 – Zeitraum	Vier Buchstaben: DAIL = täglich WEEK = wöchentlich MNTH = monatlich YEAR = jährlich ADHO = ad hoc bei unregelmäßigen Zahlungen EXPI = Zahlung bei Fälligkeit
108	Abschnitt 2h – Zinssätze	Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes Leg 2 – Multiplikator	Ein ganzzahliger Wert größer oder gleich Null, bis zu drei numerische Zeichen
109	Abschnitt 2h – Zinssätze	Spread von Leg 2	— Wird der Spread als monetärer Wert mitgeteilt – ein Wert mit bis zu 18 numerischen Zeichen, der bis zu 13 Dezimalstellen umfasst. — Wird der Spread als Prozentwert mitgeteilt – ein Wert mit bis zu elf numerischen Zeichen, die bis zu zehn Dezimalstellen umfassen, ausgedrückt als Prozentsatz (z. B. 2.57 statt 2,57 %). — Wenn der Spread als Basispunkte mitgeteilt wird – ein ganzzahliger Wert mit bis zu fünf numerischen Zeichen, ausgedrückt als Basispunkte (z. B. 257 statt 2,57 %).
110	Abschnitt 2h – Zinssätze	Währung des Spread von Leg 2	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
111	Abschnitt 2h – Zinssätze	Spread des Transaktionspakets	— Wird der Spread des Transaktionspakets als monetärer Wert mitgeteilt – ein positiver und negativer Wert mit bis zu 18 numerischen Zeichen, die bis zu 13 Dezimalstellen umfassen. Hat der Wert mehr als 13 Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an. — Wird der Spread des Transaktionspakets als Prozentwert mitgeteilt – ein positiver und negativer Wert mit bis zu elf numerischen Zeichen, die bis zu zehn Dezimalstellen umfassen, ausgedrückt als Prozentsatz (z. B. 2.57 statt 2,57 %). Hat der Wert mehr als zehn Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an. — Wenn der Spread des Transaktionspakets als Basispunkte mitgeteilt wird – ein ganzzahliger Wert mit bis zu fünf numerischen Zeichen, ausgedrückt als Basispunkte (z. B. 257 statt 2,57 %). Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.
112	Abschnitt 2h – Zinssätze	Währung des Spreads des Transaktionspakets	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
113	Abschnitt 2i – Devisen	Wechselkurs 1	Ein Wert größer als Null, bis zu 18 numerische Zeichen mit bis zu 13 Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
114	Abschnitt 2i – Devisen	Devisenterminkurs	Ein Wert größer als Null, bis zu 18 numerische Zeichen mit bis zu 13 Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
115	Abschnitt 2i – Devisen	Umrechnungsbasis	Sieben Zeichen, die zwei Währungscodes nach ISO 4217 darstellen, getrennt durch „/“, ohne Beschränkung der Reihenfolge des Währungspaars. Der erste Währungscode gibt die Währung der Einheit, der zweite die quotierte Währung an.
116	Abschnitt 2j – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Allgemeines)	Basisprodukt	Nur Eintragungen aus der Spalte „Basisprodukt“ der Tabelle zur Klassifizierung von Warenderivaten sind zulässig.
117	Abschnitt 2j – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Allgemeines)	Unterprodukt	Nur Eintragungen aus der Spalte „Unterprodukt“ der Tabelle zur Klassifizierung von Warenderivaten sind zulässig.

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
118	Abschnitt 2j – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Allgemeines)	Weiteres Unterprodukt	Nur Eintragungen aus der Spalte „Weiteres Unterprodukt“ der Tabelle zur Klassifizierung von Warenderivaten sind zulässig.
119	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Lieferpunkt oder -zone	EIC-Code, 16-stelliger alphanumerischer Code. Wiederholbares Feld.
120	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Kuppelstelle/ Kopplungspunkt	EIC-Code, 16-stelliger alphanumerischer Code.
121	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Art der Last	BSLD = Grundlast PKLD = Spitzenlast OFFP = Schwachlast HABH = Stunde/Blockstunden SHPD = geformt („shaped“) GASD = Gastag OTHR = Sonstige
	Der Abschnitt der Felder 122 bis 131 ist wiederholbar		
122	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Startzeitpunkt des Lieferintervalls	hh:mm:ssZ
123	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Endzeitpunkt des Lieferintervalls	hh:mm:ssZ
124	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Startdatum der Lieferung	Datum nach ISO 8601 (JJJJ-MM-TT)
125	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Endtermin der Lieferung	Datum nach ISO 8601 (JJJJ-MM-TT)
126	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Laufzeit	MNUT = Minuten HOUR = Stunde DASD = Tag WEEK = Woche MNTH = Monat QURT = Quartal SEAS = Saison YEAR = Jahr OTHR = Sonstige

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
127	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Wochentage	WDAY = Werktage WEND = Wochenende MOND = Montag TUED = Dienstag WEDD = Mittwoch THUD = Donnerstag FRID = Freitag SATD = Samstag SUND = Sonntag XBHL – ausgenommen Feiertage IBHL – einschließlich Feiertage Es können mehrere Werte angegeben werden
128	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Lieferkapazität	Bis zu 20 numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.
129	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Mengeneinheit	KWAT = KW KWHH = KWh/h KWHD = KWh/d MWAT = MW MWHH = MWh/h MWHD = MWh/d GWAT = GW GWHH = GWh/h GWHD = GWh/d THMD = Therm/d KTMD = KTherm/d MTMD = MTherm/d CMPD = cm/d MCMD = mcm/d BTUD = Btu/d MBTD = MMBtu/d MJDD = MJ/d HMJD = 100 MJ/d MMJD = MMJ/d GJDD = GJ/d
130	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Preis-/ Zeitintervallmenge	Bis zu 20 numerische Zeichen einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
131	Abschnitt 2k – Rohstoffe und Emissionszertifikate (Energie)	Währung der Preis-/ Zeitintervallmenge	Währungskürzel nach ISO 4217, dreistelliger alphabetischer Code
132	Abschnitt 2l – Optionen	Art der Option	Vier Buchstaben: PUTO = Put CALL = Call OTHR = wenn nicht bestimmt werden kann, ob es sich um eine Call- oder Put-Option handelt
133	Abschnitt 2l – Optionen	Ausübungsart der Option	Vier Buchstaben: AMER = Amerikanische Option BERM = Bermuda-Option EURO = Europäische Option
134	Abschnitt 2l – Optionen	Ausübungspreis	— Wenn der Ausübungspreis als monetärer Wert ausgedrückt wird: ein Wert mit bis zu 18 numerischen Zeichen, der bis zu 13 Dezimalstellen umfasst (z. B. 6,39 USD, ausgedrückt als 6.39) für Aktienoptionen, Waren-/Rohstoffoptionen, Devisenoptionen und ähnliche Produkte. Hat der Wert mehr als 13 Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an. — Wenn der Ausübungspreis als Prozentwert ausgedrückt wird: ein Wert mit bis zu elf numerischen Zeichen, der bis zu zehn Dezimalstellen umfasst, ausgedrückt als Prozentsatz (z. B. 2.1 statt 2,1 %), für im Spread notierte Zinsoptionen, Zinssätze und Kreditswaptions sowie ähnliche Produkte. Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.
	Die Felder 135 bis 137 sind wiederholbar und bei Derivaten mit Listen von Ausübungspreisen auszufüllen.		
135	Abschnitt 2l – Optionen	Geltungsbeginn des Ausübungspreises	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
136	Abschnitt 2l – Optionen	Endtermin des Ausübungspreises	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
137	Abschnitt 2l – Optionen	Ausübungspreis, der ab dem zugehörigen Geltungsbeginn gilt	— Wenn der Ausübungspreis als monetärer Wert ausgedrückt wird: ein Wert mit bis zu 18 numerischen Zeichen, der bis zu 13 Dezimalstellen umfasst (z. B. 6,39 USD, ausgedrückt als 6.39) für Aktienoptionen, Waren-/Rohstoffoptionen, Devisenoptionen und ähnliche Produkte. Hat der Wert mehr als 13 Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an. — Wenn der Ausübungspreis als Prozentwert ausgedrückt wird: ein Wert mit bis zu elf numerischen Zeichen, der bis zu zehn Dezimalstellen umfasst, ausgedrückt als Prozentsatz (z. B. 2.1 statt 2,1 %), für im Spread notierte Zinsoptionen, Zinssätze und Kreditswaptions sowie ähnliche Produkte. Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.
138	Abschnitt 2l – Optionen	Währung/ Währungspaar des Ausübungspreises	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen, oder für Devisenoptionen: sieben Zeichen, die zwei Währungscodes nach ISO 4217 darstellen, getrennt durch „/“, ohne Beschränkung der Reihenfolge des Währungspaars. Der erste Währungscode gibt die Basiswährung, der zweite die quotierte Währung an.
139	Abschnitt 2l – Optionen	Betrag der Optionsprämie	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an. Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
140	Abschnitt 2l – Optionen	Währung der Optionsprämie	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
141	Abschnitt 2l – Optionen	Zahlungstermin der Optionsprämie	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
142	Abschnitt 2i – Optionen	Fälligkeitsdatum des Basiswerts	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
143	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Rang	Vier Buchstaben: SNDB = Vorrangig, z. B. vorrangige, unbesicherte Schuldtitel (Unternehmen/Finanzinstitute), Staatsschuldtitel in Fremdwährung (Regierungen) SBOD = Nachrangig, z. B. nachrangige oder Lower-Tier-2-Schuldtitel (Banken), nachrangige (junior) oder Upper-Tier-2-Schuldtitel (Banken) OTHR = sonstige, z. B. Vorzugsaktien oder Kernkapital (Banken) oder andere Kreditderivate
144	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Referenzeinrichtung	Ländercode nach ISO 3166 – Ländercode aus zwei Buchstaben, oder Ländercode nach ISO 3166-2 – Ländercode aus zwei Buchstaben, gefolgt von einem Bindestrich („-“) und einem Länderuntercode von bis zu drei alphanumerischen Zeichen, oder Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20-stelliger alphanumerischer Code
145	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Serien	Feldnummer mit bis zu fünf Zeichen
146	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Version	Feldnummer mit bis zu fünf Zeichen
147	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Indexfaktor	Ein Wert mit bis zu elf numerischen Zeichen, der bis zu zehn Dezimalstellen umfasst, ausgedrückt als Dezimalbruch (z. B. 0.05 statt 5 %) zwischen 0 und 1 (einschließlich 0 und 1). Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
148	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Tranche	Boolescher Wert: TRUE = in Tranchen FALSE = nicht in Tranchen
149	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Attachment-Point des Kreditderivat-Swap-Index (CDS-Index)	Ein Wert mit bis zu elf numerischen Zeichen, der bis zu zehn Dezimalstellen umfasst, ausgedrückt als Dezimalbruch (z. B. 0.05 statt 5 %) zwischen 0 und 1 (einschließlich 0 und 1). Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
150	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Detachment-Point des CDS-Index	Ein Wert mit bis zu elf numerischen Zeichen, der bis zu zehn Dezimalstellen umfasst, ausgedrückt als Dezimalbruch (z. B. 0.05 statt 5 %) zwischen 0 und 1 (einschließlich 0 und 1). Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
151	Abschnitt 2n – Änderung des Derivats	Art des Vorgangs	Vier Buchstaben: NEWT = Neu MODI = Änderung CORR = Korrektur TERM = Beendigung ERROR = Fehler REVI = Wiederherstellung VALU = Bewertung POSC = Positionskomponente
152	Abschnitt 2n – Änderung des Derivats	Ereignisart	Vier Buchstaben: TRAD = Handel NOVA = Step-in COMP = PTRR ETRM = vorzeitige Kündigung CLRG = Clearing EXER =Ausübung ALOC = Zuweisung CREV = Kreditereignis CORP = Unternehmensereignis INCP = Aufnahme in die Position UPDT = Aktualisierung
153	Abschnitt 2n – Änderung des Derivats	Datum des Ereignisses	Datum nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TT
154	Abschnitt 2n – Änderung des Derivats	Ebene	Vier Buchstaben: TCTN = Geschäft PSTN = Position

Tabelle 3

	Abschnitt	Feld	Format
1	Parteien des Derivats	Meldezeitstempel	Datum und Uhrzeit nach ISO 8601 im UTC-Format (koordinierte Weltzeit) JJJJ-MM-TTThh:mm:ssZ
2	Parteien des Derivats	ID der meldenden Stelle	Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20 alphanumerische Zeichen, die in den von der Global LEI Foundation veröffentlichten LEI-Daten enthalten sind.
3	Parteien des Derivats	Für die Meldung zuständige Stelle	Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20 alphanumerische Zeichen, die in den von der Global LEI Foundation veröffentlichten LEI-Daten enthalten sind. Die LEI muss im Einklang mit den Bestimmungen einer der akkreditierten lokalen operativen Stellen des globalen LEI-Systems ordnungsgemäß erneuert werden.

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
4	Parteien des Derivats	Gegenpartei 1 (Meldende Gegenpartei)	Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20 alphanumerische Zeichen, die in den von der Global LEI Foundation veröffentlichten LEI-Daten enthalten sind. Die LEI muss im Einklang mit den Bestimmungen einer der akkreditierten lokalen operativen Stellen des globalen LEI-Systems ordnungsgemäß erneuert werden.
5	Parteien des Derivats	Art der Kennung der Gegenpartei 2	Boolescher Wert: — TRUE — FALSE, für natürliche Personen, die als Privatpersonen handeln und gemäß der „ROC-Erklärung“ keine LEI für sich beanspruchen können.
6	Parteien des Derivats	Gegenpartei 2	— Rechtsträgerkennung (LEI) nach ISO 17442, 20 alphanumerische Zeichen, die in den von der Global LEI Foundation veröffentlichten LEI-Daten enthalten sind, oder bis zu 72 alphanumerische Zeichen für natürliche Personen, die als Privatpersonen handeln und gemäß der „ROC-Erklärung“ keine LEI für sich beanspruchen können. Der Code zur Identifizierung einer natürlichen Person setzt sich aus der LEI der Gegenpartei 1 zusammen, gefolgt von einer eindeutigen Kennung, die dieser/diesen natürliche(n) Person(en) zu aufsichtsrechtlichen Meldezwecken von der Gegenpartei 1 zugewiesen und beibehalten wird.
7	Sicherheiten	Zeitstempel der Sicherheiten	Datum und Uhrzeit nach ISO 8601 im UTC-Format JJJJ-MM-TTThh:mm:ssZ
8	Sicherheiten	Indikator des besicherten Portfolios	Boolescher Wert: TRUE = auf Portfoliobasis besichert FALSE = nicht Teil eines Portfolios
9	Sicherheiten	Kennziffer des besicherten Portfolios	Bis zu 52 alphanumerische Zeichen Sonderzeichen sind nicht zulässig
10	Sicherheiten	UTI	Bis zu 52 alphanumerische Zeichen, wobei nur die Großbuchstaben A–Z und die Ziffern 0–9 zulässig sind
11	Sicherheiten	Kategorie der Besicherung	Vier Buchstaben: UNCL = unbesichert PRC1 = teilbesichert: nur Gegenpartei 1 PRC2 = teilbesichert: nur Gegenpartei 2 PRCL = teilbesichert OWC1 = einseitig besichert: nur Gegenpartei 1

▼B

	Abschnitt	Feld	Format
			OWC2 = einseitig besichert: nur Gegenpartei 2 OWP1 = einseitig/teilbesichert: Gegenpartei 1 OWP2 = einseitig/teilbesichert: Gegenpartei 2 FLCL = vollständig besichert Gemäß Artikel 5 der vorliegenden Verordnung einzutragen
12	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 hinterlegte Ersteinschusszahlung (vor Abschlag)	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an. Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
13	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 hinterlegte Ersteinschusszahlung (nach Abschlag)	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an. Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
14	Sicherheiten	Währung der hinterlegten Ersteinschusszahlung	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
15	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 hinterlegte Nachschusszahlung (vor Abschlag)	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an. Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
16	Sicherheiten	Von Gegenpartei 1 hinterlegte Nachschusszahlung (nach Abschlag)	Ein Wert größer oder gleich Null, bis zu 25 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Hat der Wert mehr als fünf Stellen nach dem Dezimaltrennzeichen, wenden die meldenden Gegenparteien die kaufmännische Rundung an. Das Dezimaltrennzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
17	Sicherheiten	Währung der hinterlegten Nachschusszahlung	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen

▼B

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

▼B

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

Tabelle 4

Klassifizierung von Waren

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

▼B

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

▼B

Basisprodukt	Unterprodukt	Weiteres Unterprodukt
	„COAL“ = 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	
„INDP“ = Industrieerzeugnisse	„CSTR“ = Baugewerbe/Bau „MFTG“ = Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	
„METL“ = Metalle	„NPRM“ = Nichtedelmetalle	„ALUM“ = Aluminium „ALUA“ = Aluminiumlegierung „CBLT“ = Kobalt „COPR“ = Kupfer „IRON“ = Eisenerz

▼B

Basisprodukt	Unterprodukt	Weiteres Unterprodukt
		„LEAD“ = Blei „MOLY“ = Molybdän „NASC“ = NASAAC „NICK“ = Nickel „STEL“ = Stahl „TINN“ = Zinn „ZINC“ = Zink „OTHR“ = Sonstiges
	„PRME“ = Edelmetalle	„GOLD“ = Gold „SLVR“ = Silber „PTNM“ = Platin „PLDM“ = Palladium „OTHR“ = Sonstiges
„MCEX“ = Multi Commodity exotisch		
„PAPR“ = Papier	„CBRD“ = Wellpappenrohpapier „NSPT“ = Zeitungsdruckpapier „PULP“ = Zellstoff „RCVP“ = Recyclingpapier „OTHR“ = Sonstiges	
„POLY“ = Polypropylen	„PLST“ = Kunststoff „OTHR“ = Sonstiges	
„INFL“ = Inflation		
„OEST“ = Offizielle Wirtschaftsstatistik		
„OTHC“ = Sonstige C10-Derivate entsprechend der Definition in Anhang III Tabelle 10.1 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583 der Kommission ([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).