II

(Rechtsakte ohne Gesetzescharakter)

VERORDNUNGEN

DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) 2022/1855 DER KOMMISSION

vom 10. Juni 2022

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

(Text von Bedeutung für den EWR)

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

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

in Erwägung nachstehender Gründe:

(1) Die Delegierte Verordnung (EU) Nr. 148/2013 vom 19. Dezember 2012 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister bezüglich technischer Regulierungsstandards für die Mindestangaben der Meldungen an Transaktionsregister wurde erheblich geändert. Da weitere Änderungen erforderlich wären, um den Melderahmen klarer zu gestalten und die Kohärenz mit neuen technischen Durchführungsstandards und anderen international vereinbarten Standards zu gewährleisten, sollte sie aufgehoben und durch diese Verordnung ersetzt werden.

(2) Die Meldung vollständiger und genauer Einzelheiten zu den Derivaten, einschließlich der Angabe der Geschäftsereignisse, durch die Änderungen an den Derivaten ausgelöst werden, ist entscheidend dafür, dass die Derivatdaten wirksam genutzt werden können.

(3) Setzt sich ein Derivatekontrakt aus mehreren Derivatekontrakten zusammen, die zusammen als Ergebnis einer einzigen wirtschaftlichen Vereinbarung ausgehandelt wurden, müssen die zuständigen Behörden die Eigenschaften eines jeden dieser Kontrakte nachvollziehen können. Da die zuständigen Behörden ebenso den Gesamtzusammenhang verstehen müssen, sollte aus der Meldung auch klar hervorgehen, dass der Derivatekontrakt Teil eines komplexen Derivats ist. Daher sollten Derivatekontrakte, die zu einer Kombination aus mehreren Derivatekontrakten gehören, in getrennten Meldungen für jeden Derivatekontrakt gemeldet und mit einer internen Kennung versehen werden, die die Verbindung zwischen den einzelnen Meldungen anzeigt.

(4) Bei Derivatekontrakten, die sich aus mehreren Derivatekontrakten zusammensetzen und daher mehr als eine Meldung erfordern, lässt sich unter Umständen nur schwer bestimmen, wie die für den einzelnen Kontrakt maßgeblichen Informationen in den einzelnen Meldungen dargelegt und wie viele Meldungen übermittelt werden sollten. Daher sollten sich die Gegenparteien bei den Angaben zu einem solchen Kontrakt über die Anzahl der zu übermittelnden Meldungen verständigen.

([1]) ABl. L 201 vom 27.7.2012, S. 1.

(5) Im Interesse der Flexibilität sollten die Gegenparteien die Möglichkeit haben, die Meldung eines Kontrakts der anderen Gegenpartei oder einem Dritten zu übertragen. Die Gegenparteien sollten auch vereinbaren können, die Meldung an eine gemeinsame dritte Stelle, wie eine zentrale Gegenpartei (im Folgenden „CCP"), zu delegieren. Um im Fall, dass eine Meldung im Namen beider Gegenparteien erfolgt, die Datenqualität sicherzustellen, sollte die Meldung alle relevanten Angaben zu jeder Gegenpartei enthalten. Wird die Meldung delegiert, so sollte die Meldung alle Einzelheiten enthalten, die gemeldet worden wären, falls die meldende Gegenpartei die Meldung vorgenommen hätte.

(6) Es ist wichtig anzuerkennen, dass eine CCP als Partei eines Derivatekontrakts fungiert. Dementsprechend sollte ein bestehender Kontrakt, der anschließend von einer CCP gecleart wird, als beendet gemeldet und der neue, sich aus dem Clearing ergebende Kontrakt ebenfalls gemeldet werden.

(7) Ebenso ist es wichtig anzuerkennen, dass bestimmte Derivate, die beispielsweise an Handelsplätzen oder organisierten Handelsplattformen außerhalb der Union gehandelt werden, durch CCPs geclearte Derivate oder Differenzgeschäfte häufig beendet und in eine Position aufgenommen werden und dass das Risiko solcher Derivate auf Positionsebene gesteuert wird. Ferner ist die daraus resultierende Position, anstelle der ursprünglichen Derivate auf Transaktionsebene, dann Gegenstand der nachfolgenden Lebenszyklusereignisse. Um eine effiziente und genaue Meldung solcher Derivate zu ermöglichen, sollte es den Gegenparteien gestattet sein, die Meldung auf Positionsebene vorzunehmen. Um sicherzustellen, dass die Gegenparteien die Meldung auf Positionsebene nicht unangemessen nutzen, sollten spezifische Bedingungen festgelegt werden, die für die Meldung auf Positionsebene erfüllt sein sollten.

(8) Damit die Konzentration von Risikopositionen und Systemrisiken ordnungsgemäß überwacht werden kann, ist zu gewährleisten, dass den Transaktionsregistern vollständige und genaue Angaben zu den Risiken und den zwischen zwei Gegenparteien ausgetauschten Sicherheiten zur Verfügung gestellt werden. Die Marktpreis- oder Modellpreisbewertung eines Kontrakts gibt Zeichen und Umfang der mit dem Kontrakt verbundenen Risiken an und ergänzt die im Kontrakt gemachten Angaben zum ursprünglichen Wert. Somit kommt es wesentlich darauf an, dass die Gegenparteien Bewertungen von Derivatekontrakten nach einer gemeinsamen Methodik melden. Ebenso wichtig ist es, auch für hinterlegte und entgegengenommene Ersteinschuss- und Nachschussleistungen eine Meldung bezüglich eines bestimmten Derivats vorzuschreiben. Daher sollten Gegenparteien, die ihre Derivate besichern, solche Einzelheiten zur Besicherung auf Transaktionsbasis melden. Werden Sicherheiten auf Portfoliobasis berechnet, sollten die Gegenparteien hinterlegte und erhaltene Ersteinschuss- und Nachschussleistungen für dieses Portfolio unter Verwendung einer von der meldenden Gegenpartei festgelegten einheitlichen Kennziffer melden. Diese einheitliche Kennziffer sollte zur Identifizierung des spezifischen Portfolios dienen, über das die Sicherheit ausgetauscht wird, und sicherstellen, dass alle relevanten Derivate mit dem betreffenden Portfolio verknüpft werden können.

(9) Der Nennbetrag ist ein wesentliches Merkmal eines Derivats zur Bestimmung der mit diesem Derivat verbundenen Verbindlichkeiten. Darüber hinaus werden Nennbeträge als eine der Messgrößen zur Bewertung der Risikopositionen, des Handelsvolumens und des Umfangs des Derivatemarkts verwendet. Daher ist eine einheitliche Meldung von Nennbeträgen von wesentlicher Bedeutung. Um sicherzustellen, dass die Gegenparteien Nennbeträge auf eine harmonisierte Weise melden, sollte die zur Berechnung des Nennbetrags erforderliche Methode für die verschiedenen Arten von Produkten festgelegt werden.

(10) Ebenso sollten Informationen über die Bepreisung der Derivate einheitlich gemeldet werden, sodass es den zuständigen Behörden möglich ist, die gemeldeten Risikopositionen zu überprüfen, die Kosten und Liquidität auf den Derivatemärkten zu bewerten und die Preise ähnlicher Produkte, die auf verschiedenen Märkten gehandelt werden, zu vergleichen.

(11) Infolge von Lebenszyklusereignissen wie Clearing, Novation oder Komprimierung werden bestimmte Derivate geschaffen, geändert oder beendet. Damit die zuständigen Behörden die Abfolge von Ereignissen auf dem Markt und die Beziehungen zwischen den gemeldeten Derivaten verstehen können, muss eine Methode zur Verknüpfung aller relevanten Derivate, die von demselben Lebenszyklusereignis betroffen sind, bereitgestellt werden. Da die wirksamste Art der Verknüpfung der Derivate von der Art des Ereignisses abhängt, sollten unterschiedliche Verknüpfungsmethoden festgelegt werden.

(12) Diese Verordnung beruht auf dem Entwurf technischer Regulierungsstandards, der der Kommission von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) vorgelegt wurde.

(13) Die ESMA hat zu dem Entwurf technischer Regulierungsstandards, der dieser Verordnung zugrunde liegt, öffentliche Konsultationen durchgeführt, die potenziellen Kosten- und Nutzeffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates ([2]) eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt.

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

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

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

Artikel 1

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

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

Diese Einzelheiten sind in einer einzigen Meldung zu übermitteln.

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

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

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

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

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

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

Artikel 2

Geclearte Geschäfte

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

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

Artikel 3

Meldung auf Positionsebene

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

a) das Risiko wird auf Positionsebene gesteuert,

b) die Meldungen beziehen sich auf Derivate, die an einem Handelsplatz bzw. auf einer organisierten Handelsplattform außerhalb der Union abgeschlossen wurden, auf Derivate, die von einer CCP gecleart wurden, oder auf fungible Differenzgeschäfte, die durch die Position ersetzt wurden,

c) die in Feld 154 der Tabelle 2 des Anhangs genannten Derivate auf Transaktionsebene wurden vor ihrer Aufnahme in die Position korrekt gemeldet,

d) sonstige Ereignisse, die die gemeinsamen Felder in der Meldung über die Position betreffen, werden getrennt gemeldet,

e) die unter Buchstabe b genannten Derivate wurden ordnungsgemäß beendet, indem in Feld 151 der Tabelle 2 des Anhangs „Beendigung" als Art des Vorgangs und in Feld 152 der Tabelle 2 des Anhangs „Aufnahme in eine Position" als Ereignisart angegeben wurde,

f) die daraus resultierende Position wurde entweder als neue Position oder als Aktualisierung einer bestehenden Position ordnungsgemäß gemeldet,

g) die Meldung der Position ist korrekt erfolgt, indem alle einschlägigen Felder der Tabellen 1 und 2 des Anhangs ausgefüllt wurden und darauf hingewiesen wurde, dass die Meldung auf Positionsebene in Feld 154 der Tabelle 2 des Anhangs erfolgt,

h) die Gegenparteien des Derivats kommen darin überein, dass das Derivat auf Positionsebene gemeldet werden sollte.

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

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

Artikel 4

Meldung von Risiken

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

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

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

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

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

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

Artikel 5

Nennbetrag

(1) Der in den Feldern 55 und 64 der Tabelle 2 des Anhangs genannte Nennbetrag des Derivates ist:

a) bei in Geldeinheiten gehandelten Swaps, börsengehandelten Finanzterminkontrakten, außerbörslichen Finanzterminkontrakten und Optionen der Referenzbetrag,

b) bei anderen als den unter Buchstabe a genannten Optionen der Basispreis,

c) bei anderen als den unter Buchstabe a genannten außerbörslichen Finanzterminkontrakten das Produkt aus dem Terminkurs und der gesamten Nennmenge des Basiswerts,

d) bei Aktien-Dividenden-Swaps das Produkt aus dem für den Zeitraum festgelegten Basispreis und der Anzahl der Aktien oder Indexeinheiten,

e) bei Aktien-Volatilitäts-Swaps der Vega-Nennbetrag,

f) bei Aktien-Varianz-Swaps den Varianzbetrag,

g) bei finanziellen Differenzgeschäften der sich aus dem Anfangspreis und der gesamten Nennmenge ergebende Betrag,

h) bei Fix/Float-Swaps im Zusammenhang mit Waren/Rohstoffen das Produkt aus dem Festpreis und der gesamten Nennmenge,

i) bei Waren-/Rohstoff-Basisswaps das Produkt aus dem letzten zum Zeitpunkt der Transaktion verfügbaren Kassakurs des Basiswerts des „Legs“ ohne Spread und der gesamten Nennmenge des „Legs“ ohne Spread,

j) bei Swaptions der Nennbetrag des Basiskontrakts,

k) bei nicht unter den Buchstaben a) bis j) genannten Derivaten, bei denen der Nennbetrag anhand des Preises des Basiswerts berechnet wird und dieser Preis nur zum Zeitpunkt der Abrechnung verfügbar ist, der Tagesschlusspreis des Basiswerts zum Zeitpunkt des Abschlusses des Kontrakts.

(2) Bei der erstmaligen Meldung eines Derivatekontrakts, dessen Nennbetrag sich im Laufe der Zeit verändert, sind der Nennbetrag zum Zeitpunkt des Abschlusses des Derivatekontrakts und der Zeitplan für den Nennbetrag anzugeben.

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

i) den nicht aktualisierten Zeitpunkt, zu dem der zugehörige Nennbetrag wirksam wird,

ii) den nicht aktualisierten Endtermin des Nennbetrags,

iii) den Nennbetrag, der am zugehörigen nicht aktualisierten Tag des Wirksamwerdens wirksam wird.

Artikel 6

Preis

(1) Der in Feld 48 der Tabelle 2 des Anhangs genannte Preis eines Derivats ist:

a) bei Swaps mit periodischen Zahlungen in Bezug auf Rohstoffe der Festpreis,

b) bei außerbörslichen Finanzterminkontrakten, die sich auf Waren/Rohstoffe und Aktien beziehen, der Terminkurs des Basiswerts,

c) bei Swaps, die sich auf Aktien und Differenzgeschäfte beziehen, der Ausgangspreis des Basiswerts.

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

Artikel 7

Verknüpfung der Meldungen

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

a) bei Clearing, Step-in, Zuordnung und Ausübung meldet die Gegenpartei die eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer („UTI“) des ursprünglichen Derivats, das infolge des in Feld 152 in Tabelle 2 des Anhangs genannten Ereignisses beendet wurde, in Feld 3 der Tabelle 2 des Anhangs im Rahmen der Meldung oder den Meldungen zu dem Derivat oder den Derivaten, die aus diesem Ereignis resultiert sind,

b) bei der Aufnahme eines Derivats in eine Position meldet die Gegenpartei die UTI der Position, in die dieses Derivat gemäß Feld 4 in Tabelle 2 des Anhangs aufgenommen wurde, im Rahmen der Meldung dieses Derivats, die mit „Positionskomponente“ als Art des Vorgangs oder einer Kombination aus „Beendigung“ als Art des Vorgangs und „Aufnahme in eine Position“ als Ereignisart übermittelt wurde.

c) bei einem Ereignis zur Verringerung von Nachhandelsrisiken (im Folgenden „PTRR“) bei einem PTRR-Dienstleister oder einer CCP, die den PTRR-Dienst erbringt, meldet die Gegenpartei in allen Meldungen zu den Derivaten, die entweder aufgrund dieses Ereignisses beendet wurden oder daraus resultieren, in Feld 5 in Tabelle 2 des Anhangs eine einheitliche Kennziffer zur Identifizierung dieses Ereignisses.

Artikel 8

Aufhebung

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

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

Artikel 9

Inkrafttreten

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

Sie gilt ab dem 29. April 2024.

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

Brüssel, den 10. Juni 2022

Für die Kommission
Die Präsidentin
Ursula VON DER LEYEN

ANHANG

Tabelle 1

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

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

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

([1]) 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).

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

Tabelle 2

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
111	Abschnitt 2h – Zinssätze	Spread des Transaktionspakets	Gehandelter Preis des gesamten Pakets, in dem das gemeldete Derivategeschäft eine Komponente des Transaktionspakets bildet. Preis des Transaktionspakets; wenn der Preis des Pakets als Spread ausgedrückt wird, die Differenz zwischen zwei Referenzpreisen. Dieses Datenelement gilt nicht, wenn — es sich nicht um ein Paket handelt oder — der Preis des Transaktionspakets verwendet wird. Der Spread und damit verbundene Datenelemente der Transaktionen (Währung des Spread), die einzelne Komponenten des Pakets darstellen, werden gemeldet wenn sie verfügbar sind. Bei Meldung einer neuen Transaktion ist der Spread des Transaktionspakets möglicherweise nicht bekannt; er kann aber zu einem späteren Zeitpunkt aktualisiert werden.
112	Abschnitt 2h – Zinssätze	Währung des Spreads des Transaktionspakets	Währung, in der der Spread des Transaktionspakets angegeben ist. Dieses Datenelement gilt nicht, wenn — es sich nicht um ein Paket handelt oder — der Preis des Transaktionspakets verwendet wird, oder — der Spread des Transaktionspakets als Prozentwert oder in Basispunkten ausgedrückt wird.
113	Abschnitt 2i – Devisen	Wechselkurs 1	Wechselkurs zwischen den beiden verschiedenen Währungen, die in dem von den Gegenparteien zu Beginn des Geschäfts vereinbarten Derivategeschäft angegeben sind, ausgedrückt als Wechselkurs aus der Umrechnung der Einheitswährung in die notierte Währung.
114	Abschnitt 2i – Devisen	Devisenterminkurs	Devisenterminkurs, wie zwischen den Gegenparteien in der vertraglichen Vereinbarung vereinbart. Anzugeben als Preis der Basiswährung in der notierten Währung.
115	Abschnitt 2i – Devisen	Umrechnungsbasis	Währungspaar und Reihenfolge, in der der Wechselkurs lautet, ausgedrückt als Währungseinheit oder notierte Währung.
116	Abschnitt 2j – Rohstoffe/Waren und Emissionszertifikate (Allgemeines)	Basisprodukt	Basisprodukt gemäß der Klassifizierung von Warenderivaten in Tabelle 4 des Anhangs der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860.
117	Abschnitt 2j – Rohstoffe/Waren und Emissionszertifikate (Allgemeines)	Unterprodukt	Unterprodukt gemäß der Klassifizierung von Warenderivaten in Tabelle 4 des Anhangs der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860. Dieses Feld erfordert ein spezielles Basisprodukt in dem Feld.
118	Abschnitt 2j – Rohstoffe/Waren und Emissionszertifikate (Allgemeines)	Weiteres Unterprodukt	Weiteres Unterprodukt gemäß der Klassifizierung von Warenderivaten in Tabelle 4 des Anhangs der Durchführungsverordnung (EU) 2022/1860. Dieses Feld erfordert ein spezielles Unterprodukt in dem Feld.

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

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
129	Abschnitt 2k – Rohstoffe/Waren und Emissionszertifikate (Energie)	Mengeneinheit	Verwendete Maßeinheit.
130	Abschnitt 2k – Rohstoffe/Waren und Emissionszertifikate (Energie)	Preis-/ Zeitintervallmenge	Falls zutreffend, Preis pro Menge je Lieferzeitspanne.
131	Abschnitt 2k – Rohstoffe/Waren und Emissionszertifikate (Energie)	Währung der Preis-/ Zeitintervallmenge	Währung, in der der Preis je Zeitintervallmenge ausgedrückt wird.
132	Abschnitt 2l – Optionen	Art der Option	Angabe, ob es sich beim Derivatekontrakt um eine Call-Option (Berechtigung zum Erwerb eines spezifischen Basiswerts) oder eine Put-Option (Berechtigung zum Verkauf eines spezifischen Basiswerts) handelt oder ob zum Zeitpunkt der Ausführung des Derivatekontrakts nicht bestimmt werden kann, ob es sich um eine Call- oder Put-Option handelt. Im Fall von Swaptions gilt Folgendes: — „Put-Option“, wenn es sich um eine Receiver Swaption handelt, bei der der Käufer das Recht hat, in einen Swap einzutreten, in dem er einen festen Zinssatz empfängt. — „Call-Option“, wenn es sich um eine Payer Swaption handelt, bei der der Käufer das Recht hat, in einen Swap einzutreten, in dem er einen festen Zinssatz zahlt. Im Fall von Caps und Floors gilt Folgendes: — „Put-Option“ im Falle eines Floors. — „Call-Option“ im Falle eines Caps.
133	Abschnitt 2l – Optionen	Optionstyp	Gibt an, ob die Option ausschließlich zu einem bestimmten Termin (europäische Option), zu verschiedenen im Voraus festgelegten Terminen (Bermuda-Option) oder jederzeit vor ihrem Verfallsdatum (amerikanische Option) ausgeübt werden kann.
134	Abschnitt 2l – Optionen	Ausübungspreis	— Bei anderen Optionen als FX-Optionen, Swaptions und ähnlichen Produkten ist der Preis anzugeben, zu dem der Inhaber einer Option den Basiswert der Option kaufen oder verkaufen kann. — Bei Fremdwährungsoptionen ist der Wechselkurs, zu dem die Option ausgeübt werden kann, anzugeben, ausgedrückt als Wechselkurs aus der Umrechnung der Einheitswährung in die notierte Währung. Im Beispiel 0,9426 USD/EUR ist USD die Einheitswährung und EUR die notierte Währung; 1 USD = 0,9426 EUR. Ist der Preis bei Meldung einer neuen Transaktion nicht bekannt, wird der Preis aktualisiert, sobald die Information dazu verfügbar ist. — Bei Volatilitäts- und Varianzswaps und ähnlichen Produkten wird der Volatilitätsausübungspreis in diesem Datenelement gemeldet.
	Die Felder 135 bis 137 sind wiederholbar und bei Derivaten mit Listen von Ausübungspreisen auszufüllen.		

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

	Abschnitt	Feld	Zu meldende Angaben
150	Abschnitt 2m – Kreditderivate	Detachment-Point des CDS-Index	Definierter Punkt, ab dem Verluste im Basis-Portfolio den Nennbetrag einer Tranche nicht mehr verringern. So wird beispielsweise der Nennbetrag in einer Tranche mit einem Attachment-Point von 3 % und einem Detachment-Point von 6 % verringert, nachdem 3 % der Verluste im Portfolio aufgetreten sind. Bei 6 % Verlusten im Portfolio ist der Nennwert der Tranche erschöpft. Dieses Datenelement gilt nicht, wenn es sich bei der Transaktion nicht um eine CDS-Tranche (Index- oder kundenspezifischen Korb) handelt.
151	Abschnitt 2n – Änderung des Derivats	Art des Vorgangs	— Neu: Erstmalige Meldung eines Derivats auf Handels- oder Positionsebene. — Änderung: Eine Änderung der Bedingungen oder Einzelheiten eines zuvor gemeldeten Derivats auf Handels- oder Positionsebene, jedoch keine Korrektur einer Meldung. — Korrektur: Eine Meldung zur Berichtigung der fehlerhaften Datenfelder einer zuvor übermittelten Meldung. — Beendigung: Die Beendigung eines bestehenden Derivats auf Handels- oder Positionsebene. — Fehler: Die Annullierung einer ganzen Meldung, die irrtümlich gemacht wurde, wenn der Kontrakt auf Handels- oder Positionsebene nie zustande kam oder nicht unter die Meldepflicht nach der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 fiel, aber dennoch fälschlicherweise an ein Transaktionsregister gemeldet wurde; bzw. die Löschung einer Doppelmeldung. — Wiederherstellung: Wiedereröffnung eines Derivats auf Transaktions- oder Positionsebene, das mit Art des Vorgangs „Fehler“ annulliert oder versehentlich beendet wurde. — Bewertung: Die Aktualisierung der Bewertung eines Derivats auf Transaktions- oder Positionsebene — Positionskomponente: Die Meldung eines neuen Derivats, das in einer gesonderten Positionsmeldung am selben Tag enthalten ist.
152	Abschnitt 2n – Änderung des Derivats	Art des Ereignisses	— Geschäft: Abschluss eines Derivats oder Neuaushandlung seiner Bedingungen, die nicht zu einer Änderung der Gegenpartei führen — Step-in: Ein Ereignis, bei dem das Derivat ganz oder teilweise auf eine Gegenpartei 2 übertragen (und als neues Derivat gemeldet) wird und das bestehende Derivat entweder beendet oder sein Nennbetrag geändert wird. — PTRR: Maßnahmen zur Verringerung von Nachhandelsrisiken — Vorzeitige Beendigung: Die Beendigung eines bestehenden Derivats auf Transaktions- oder Positionsebene — Clearing: Clearing gemäß Artikel 2 Nummer 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 — Ausübung: Die vollständige oder teilweise Ausübung einer Option oder einer Swaption durch eine Gegenpartei der Transaktion. — Zuweisung: Zuweisungsereignis, bei dem ein bestehendes Derivat verschiedenen Gegenparteien zugeordnet wird und infolgedessen neue Derivate mit verringerten Nennbeträgen gemeldet werden. — Kreditereignis: Gilt nur für Kreditderivate. Ein Kreditereignis, das zur Änderung eines Derivats auf Transaktions- oder Positionsebene führt.

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

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

Tabelle 3

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

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

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

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

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

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

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