



Rat der
Europäischen Union

048735/EU XXVI. GP
Eingelangt am 20/12/18

Brüssel, den 20. Dezember 2018
(OR. en)

15820/18
ADD 1

EF 351
ECOFIN 1246
DELECT 190

ÜBERMITTLUNGSVERMERK

| | |
|----------------|--|
| Absender: | Herr Jordi AYET PUIGARNAU, Direktor, im Auftrag des Generalsekretärs der Europäischen Kommission |
| Eingangsdatum: | 13. Dezember 2018 |
| Empfänger: | Herr Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, Generalsekretär des Rates der Europäischen Union |

| | |
|----------------|---|
| Nr. Komm.dok.: | C(2018) 8332 final ANNEXES 1 to 2 |
| Betr.: | ANHÄNGE der DELEGIERTEN VERORDNUNG (EU) DER KOMMISSION zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für die Erhebung, die Überprüfung, die Aggregation, den Vergleich und die Veröffentlichung von Daten über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFT) durch Transaktionsregister |

Die Delegationen erhalten in der Anlage das Dokument C(2018) 8332 final ANNEXES 1 to 2.

Anl.: C(2018) 8332 final ANNEXES 1 to 2



Brüssel, den 13.12.2018
C(2018) 8332 final

ANNEXES 1 to 2

ANHÄNGE

der

DELEGIERTEN VERORDNUNG (EU) DER KOMMISSION

zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für die Erhebung, die Überprüfung, die Aggregation, den Vergleich und die Veröffentlichung von Daten über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFT) durch Transaktionsregister

ANHANG I

Tabelle 1

Felder für den Abgleich, Toleranzen und Starttermin für die Abgleichsphase

| Tabelle | Abschnitt | Feld | Toleranz | Starttermin gemäß: |
|-------------------------|------------------|---|-----------------|--|
| Angaben zur Gegenpartei | ENTFÄLLT | Meldende Gegenpartei | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Angaben zur Gegenpartei | ENTFÄLLT | Seite der Gegenpartei | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Angaben zur Gegenpartei | ENTFÄLLT | Andere Gegenpartei | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Individuelle Transaktionskennziffer („UTI“) | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Art des Wertpapierfinanzierungsgeschäfts | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Gecleart | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Clearing-Zeitstempel | eine Stunde | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | CCP | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |

| Tabelle | Abschnitt | Feld | Toleranz | Starttermin gemäß: |
|-------------------|------------------|----------------------------------|-----------------|--|
| Transaktionsdaten | Darlehen | Handelsplatz | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Art der Rahmenvereinbarung | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Ausführungszeitstempel | eine Stunde | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Valutierungstermin (Starttermin) | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Fälligkeitsdatum (Endtermin) | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Kontraktende | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Mindestkündigungsfrist | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Frühester Call-back-Termin | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Allgemeiner Sicherheitsindikator | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 |

| Tabelle | Abschnitt | Feld | Toleranz | Starttermin gemäß: |
|-------------------|------------------|---|---|---|
| | | | | + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | DBV-Indikator (DBV = Delivery By Value) | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Methode, nach der Sicherheiten bereitgestellt werden | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Unbefristet | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Optionale Kündigung | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Festsatz | Bis zu drei Stellen nach dem Dezimal- zeichen | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Zinsberechnungs- methode | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Variabler Zinssatz | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Referenzzeitraum für variablen Satz – Zeitraum | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |

| Tabelle | Abschnitt | Feld | Toleranz | Starttermin gemäß: |
|-------------------|------------------|---|---|--|
| Transaktionsdaten | Darlehen | Referenzzeitraum für variablen Satz – Multiplikator | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Zahlungshäufigkeit variabler Satz – Zeitraum | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Zahlungshäufigkeit variabler Satz – Multiplikator | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Anpassungshäufigkeit variabler Satz – Zeitraum | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Anpassungshäufigkeit variabler Satz – Multiplikator | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Spread | Bis zu drei Stellen nach dem Dezimalzeichen | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Währungsbetrag Lombardkredite | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Währung Lombardkredite | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung |

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

| Tabelle | Abschnitt | Feld | Toleranz | Starttermin gemäß: |
|-------------------|------------------|-----------------------------------|-----------------|---|
| | | | | (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Unterprodukt | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Weiteres Unterprodukt | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Menge oder Nominalbetrag | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Maßeinheit | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Währung des Nominalbetrags | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Wertpapier- oder Rohstoffpreis | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Währung des Preises | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Wertpapierqualität | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung |

| Tabelle | Abschnitt | Feld | Toleranz | Starttermin gemäß: |
|-------------------|------------------|--|---|--|
| | | | | (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Fälligkeit des Wertpapiers | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Land des Emittenten | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Rechtsträgerkennung (LEI) des Emittenten | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Art des Wertpapiers | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Kreditbetrag | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Marktwert | 0,0005 % | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Verbilligter Satz (fest) | Bis zu drei Stellen nach dem Dezimalzeichen | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Verbilligter Satz (variabel) | Bis zu drei Stellen nach dem Dezimalzeichen | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Referenzzeitraum | Keine | Artikel 33 Absatz 2 |

| Tabelle | Abschnitt | Feld | Toleranz | Starttermin gemäß: |
|-------------------|------------------|--|---|--|
| | | für variablen verbilligten Satz – Zeitraum | | Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Referenzzeitraum für variablen verbilligten Satz – Multiplikator | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Zahlungshäufigkeit variabler verbilligter Satz – Zeitraum | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Zahlungshäufigkeit variabler verbilligter Satz – Multiplikator | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Anpassungshäufigkeit variabler verbilligter Satz – Zeitraum | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Anpassungshäufigkeit variabler verbilligter Satz – Multiplikator | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Spread des verbilligten Satzes | Bis zu drei Stellen nach dem Dezimalzeichen | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Leihgebühr | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |

| Tabelle | Abschnitt | Feld | Toleranz | Starttermin gemäß: |
|-------------------|------------------|---|-----------------|---|
| Transaktionsdaten | Darlehen | Ausschließlichkeits-vereinbarungen | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Ausstehender Lombardkredit | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Basiswährung des ausstehenden Lombardkredits | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Marktwert von Short-Positionen | 0,0005 % | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Be-sicherung | Signalisierung eines unbesicherten Wertpapierleihgeschäfts („SL“, Securities Lending) | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Be-sicherung | Besicherung des Nettoforderungswerts | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Be-sicherung | Valutierungstermin der Sicherheit(en) | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Be-sicherung | Art der Sicherheitskomponente | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Be-sicherung | Höhe Barsicherheit(en) | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |

| Tabelle | Abschnitt | Feld | Toleranz | Starttermin gemäß: |
|-------------------|------------------|--|-----------------|---|
| Transaktionsdaten | Be-sicherung | Währung Barsicherheit(en) | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Be-sicherung | Kennung eines als Sicherheit hinterlegten Wertpapiers | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Be-sicherung | Klassifizierung eines als Sicherheit hinterlegten Wertpapiers | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Be-sicherung | Zugrunde liegendes Produkt | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Be-sicherung | Unterprodukt | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Be-sicherung | Weiteres Unterprodukt | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer iv der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Be-sicherung | Anzahl oder Nominalbetrag der Sicherheiten | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Be-sicherung | Maßeinheit der Sicherheit(en) | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 + 24 Monate |
| Transaktionsdaten | Be-sicherung | Währung des Nominalbetrags der | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i |

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

| Tabelle | Abschnitt | Feld | Toleranz | Starttermin gemäß: |
|-------------------|------------------|---|-----------------|--|
| Transaktionsdaten | Be-sicherung | Art der Sicherheit(en) | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Be-sicherung | Möglichkeit der Wiederverwendung einer Sicherheit | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Be-sicherung | Kennung Sicherheitenkorb | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |
| Transaktionsdaten | Darlehen | Stufe | Keine | Artikel 33 Absatz 2 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2015/2365 |

Tabelle 2
Gründe für die Zurückweisung einer SFT-Meldung

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

Tabelle 3
Ergebnisse des Abgleichprozesses

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

ANHANG II

Tabelle 1 – Öffentliche Daten

| Tabelle A. Aggregation | | | | | | | | | | | | | |
|-------------------------------|------------------|------------------------|--------------------------------|--|--|---|---|---------------|--|---------------------------------|--|---|--|
| Datum | T R | Art der Aggregation | Art des Handelsplat- zes | Standort der meldende n Gegenpar- tei | Standort der anderen Gegenpar- tei | Abgleich | Art Wertpapierfinanzierungsge- schäfts | Geclea- rt | Methode der Sicherheitenübertra- gung | Referenzind- ex ¹ | Aggregier- ter Kreditbet- rag | Aggregierte Anzahl der Transaktio- nen | Aggregier- ter Wert der Sicherheit- en |
| 201610 07 | E U T R | Gemeldet | XXXX | EWR | EWR | Zweiseiti- g, Kredit abgeglichen, Sicherheit nicht abgeglichen | Repo | Ja | TTCA | | ... | | ... |
| ... | ... | Ausstehend | XOFF | Nicht- EWR | Nicht- EWR | Zweiseiti- g, Kredit abgeglichen, Sicherheit abgeglichen | BSB/SBB | Nein | SICA | | ... | | ... |
| ... | ... | ... | EWR MIC | ... | ... | Einseitig EWR, Kredit abgeglichen, Sicherheit abgeglichen | Wertpapier- Warenverleih- leihgeschäfte | oder - | ... | SIUR | ... | | ... |

¹ Hier sind die in Tabelle 2 Feld 25 „Angaben zu Darlehen und Sicherheiten“ in Anhang I der [OP: Verweis auf den gemäß Artikel 4 Absatz 10 SFTR erlassenen ITS zum Meldewesen einfügen] genannten jeweiligen Indizes anzugeben.

| | | | | | | | | | | | | | |
|-----|-----|-----|------------------|-----|-----|-----|----------------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| ... | ... | ... | Nicht-EWR MIC | ... | ... | ... | Lombardkredite | ... | | | ... | | ... |
| ... | ... | ... | ... | ... | ... | ... | ... | ... | ... | ... | ... | ... | ... |