

Brüssel, den 31. Oktober 2025  
(OR. en)

14785/25  
ADD 1

EF 360  
ECOFIN 1447  
DELECT 166  
*ECB*

### ÜBERMITTLUNGSVERMERK

---

Absender:	Frau Martine DEPREZ, Direktorin, im Auftrag der Generalsekretärin der Europäischen Kommission
Eingangsdatum:	29. Oktober 2025
Empfänger:	Frau Thérèse BLANCHET, Generalsekretärin des Rates der Europäischen Union

---

Nr. Komm.dok.:	C(2025) 7124 annex
Betr.:	ANHÄNGE der DELEGIERTEN VERORDNUNG (EU) .../... DER KOMMISSION zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Festlegung der operativen Bedingungen, der Repräsentativitätspflicht und der Meldepflichten im Zusammenhang mit der Anforderung bezüglich eines aktiven Kontos

---

Die Delegationen erhalten in der Anlage das Dokument C(2025) 7124 annex.

Anl.: C(2025) 7124 annex



Brüssel, den 29.10.2025

C(2025) 7124 final

ANNEXES 1 to 3

## **ANHÄNGE**

**der**

### **DELEGIERTEN VERORDNUNG (EU) .../... DER KOMMISSION**

**zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Festlegung der operativen Bedingungen, der Repräsentativitätspflicht und der Meldepflichten im Zusammenhang mit der Anforderung bezüglich eines aktiven Kontos**

## ANHANG I

Derivatekategorien und wichtige Unterkategorien für die Zwecke der Repräsentativitätspflicht

*Tabelle 1*

### **Unterkategorien für EUR Fixed-to-Float**

	Geschäftsgröße (in Mio. EUR)		
Laufzeit	[0-25M]	(25M-50M)	(50M+)
[0-5Y]			
(5Y-10Y)			
(10Y-15Y)			
(15Y+)			

*Tabelle 2*

### **Unterkategorien für EUR OIS**

	Geschäftsgröße (in Mio. EUR)		
Laufzeit	[0-25M]	(25M-100M)	(100M+)
[0-1Y]			
(1Y-2Y)			
(2Y-5Y)			
(5Y+)			

*Tabelle 3*

### **Unterkategorien für EUR FRA**

	Geschäftsgröße (in Mio. EUR)		
Laufzeit	[0-75M]	(75M-200M)	(200M+)
[0-6M]			
(6M-12M)			
(12M-18M)			
(18M+)			

*Tabelle 4*

### **Unterkategorien für PLN Fixed-to-Float**

	Geschäftsgröße (in Mio. PLN)		
--	------------------------------	--	--

Laufzeit	Alle Geschäftsgrößen
Alle Laufzeiten	

*Tabelle 5*

**Unterkategorien für PLN FRA**

	Geschäftsgröße (in Mio. PLN)
Laufzeit	Alle Geschäftsgrößen
Alle Laufzeiten	

*Tabelle 6*

**Derivatekategorien für EUR STIR**

Ausführung	Basiswert	Referenzindex	Abwicklungswährung	Art der Abwicklungswährung	Optionalität
EU- oder Drittland-Börse	3-Monats-Zinssatz	Euribor	EUR	Einheitliche Währung	Ausgeschlossen
EU- oder Drittland-Börse	3-Monats-Zinssatz	€STR	EUR	Einheitliche Währung	Ausgeschlossen

*Tabelle 7*

**Unterkategorien für Euribor-referenzierte EUR STIR**

	Geschäftsgröße (in Mio. EUR)
Laufzeit	Alle Geschäftsgrößen
[0-6M]	
(6M-12M]	
(12M-24M]	
(24M+]	

*Tabelle 8*

**Unterkategorien für €STR-referenzierte EUR STIR**

	Geschäftsgröße (in Mio. EUR)
Laufzeit	Alle Geschäftsgrößen

[0-6M]	
(6M-12M]	
(12M-24M]	
(24M+]	

## **ANHANG II**

Vorlagen gemäß Artikel 7

*Tabelle 1*

### **Informationen zur Gegenpartei**

	<b>Feld</b>	<b>Zu meldende Angaben</b>
1	Meldestichtag	Datum, an dem die Meldung gegenüber der zuständigen Behörde erfolgt.
2	Gegenpartei, die den Anforderungen bezüglich eines aktiven Kontos unterliegt	Die Rechtsträgerkennung (LEI) der Gegenpartei eines Derivatgeschäfts, 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.
3	Art der Gegenpartei	Geben Sie an, ob es sich bei der Gegenpartei um eine CCP, eine finanzielle Gegenpartei oder eine nichtfinanzielle Gegenpartei im Sinne des Artikels 2 Nummern 1, 8 bzw. 9 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 oder um eine Stelle im Sinne des Artikels 1 Nummer 5 der genannten Verordnung handelt.
4	Unternehmen der Gruppe	Eine Liste der Rechtsträgerkennungen (LEI) der Unternehmen der Gruppe.
5	Oberstes Mutterunternehmen	Rechtsträgerkennung (LEI) des obersten Mutterunternehmens.
6	Clearingmitglied	Rechtsträgerkennung (LEI) des Clearingmitglieds.

*Tabelle 2*

### **Tätigkeiten und Risikopositionen**

	<b>Feld</b>	<b>Zu meldende Angaben</b>	<b>Gesamtsumme</b>
1	Ausstehender Brutto-Nominalwert der aggregierten	Die aggregierte Summe des Nennbetrags von Leg 1 und	

	durchschnittlichen Monatsendposition für die vorausgegangenen zwölf Monate in den gemäß Artikel 7a Absatz 6 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 geclearten Kategorien von Derivatekontrakten	gegebenenfalls des Nennbetrags von Leg 2 für die meldepflichtigen Derivate gemäß Artikel 5 der Verordnung (EU) 2022/1855 der Kommission.									
2	Dimension 1 – Gesamtaufschlüsselung nach Derivatekategorie	EUR OTC IRD			PLN OTC ORD			EUR STIR			
3	Dimension 2 – Aufschlüsselung nach CCP (EU/Tier 2/Tier 1) (Meldung auf CCP-LEI-Ebene)	CCP1	CCP2	...	CCP1	CCP2	...	CCP1	CCP2	...	

### **ANHANG III**

#### Meldung zur Repräsentativitätspflicht

*\*Bitte geben Sie die Anzahl der Geschäfte je Unterkategorie pro Kategorie von Derivatekontrakten und pro anwendbarem Referenzzeitraum an.*

*Tabelle 1*

#### **Unterkategorien für EUR Fixed-to-Float**

Referenzzeitraum							
Clearingdienst von wesentlicher Systemrelevanz gemäß Artikel 25 Absatz 2c				Zugelassene CCP gemäß Artikel 14			
	Geschäftsgröße (in Mio. EUR)				Geschäftsgröße (in Mio. EUR)		
Laufzeit	[0-25M]	(25M-50M]	(50M+]	Laufzeit	[0-25M]	(25M-50M]	(50M+]
[0-5Y]				[0-5Y]			
(5Y-10Y]				(5Y-10Y]			
(10Y-15Y]				(10Y-15Y]			
(15Y+]				(15Y+]			

*Tabelle 2*

#### **Unterkategorien für EUR OIS**

Referenzzeitraum							
Clearingdienst von wesentlicher Systemrelevanz gemäß Artikel 25 Absatz 2c				Zugelassene CCP gemäß Artikel 14			
	Geschäftsgröße (in Mio. EUR)				Geschäftsgröße (in Mio. EUR)		
Laufzeit	[0-25M]	(25M-100M]	(100M+]	Laufzeit	[0-25M]	(25M-100M]	(100M+]
[0-1Y]				[0-1Y]			
(1Y-2Y]				(1Y-2Y]			
(2Y-5Y]				(2Y-5Y]			
(5Y+]				(5Y+]			

Tabelle 3

**Unterkategorien für EUR FRA**

Referenzzeitraum							
Clearingdienst von wesentlicher Systemrelevanz gemäß Artikel 25 Absatz 2c				Zugelassene CCP gemäß Artikel 14			
	Geschäftsgröße (in Mio. EUR)				Geschäftsgröße (in Mio. EUR)		
Laufzeit	[0-75M]	(75M-200M]	(200M+]	Laufzeit	[0-25M]	(25M-100M]	(100M+]
[0-6M]				[0-6M]			
(6M-12M]				(6M-12M]			
(12M-18M]				(12M-18M]			
(18M+]				(18M+]			

Tabelle 4

**Unterkategorien für PLN Fixed-to-Float**

Clearingdienst von wesentlicher Systemrelevanz gemäß Artikel 25 Absatz 2c		Zugelassene CCP gemäß Artikel 14	
	Geschäftsgröße (in Mio. PLN)		Geschäftsgröße (in Mio. PLN)
Laufzeit	Alle Geschäftsgrößen	Laufzeit	Alle Geschäftsgrößen
Alle Laufzeiten		Alle Laufzeiten	

Tabelle 5

**Unterkategorien für PLN FRA**

Clearingdienst von wesentlicher Systemrelevanz gemäß Artikel 25 Absatz 2c		Zugelassene CCP gemäß Artikel 14	
	Geschäftsgröße (in Mio. PLN)		Geschäftsgröße (in Mio. PLN)
Laufzeit	Alle Geschäftsgrößen	Laufzeit	Alle Geschäftsgrößen
Alle		Alle	

Laufzeiten		Laufzeiten	
------------	--	------------	--

*Tabelle 6*

**Unterkategorien für Euribor-referenzierte EUR STIR**

Referenzzeitraum			
Clearingdienst von wesentlicher Systemrelevanz gemäß Artikel 25 Absatz 2c		Zugelassene CCP gemäß Artikel 14	
	Geschäftsgröße (in Mio. EUR)		Geschäftsgröße (in Mio. EUR)
Laufzeit	Alle Geschäftsgrößen	Laufzeit	Alle Geschäftsgrößen
[0-6M]		[0-6M]	
(6M-12M]		(6M-12M]	
(12M-24M]		(12M-24M]	
(24M+]		(24M+]	

*Tabelle 7*

**Unterkategorien für €STR-referenzierte EUR STIR**

Referenzzeitraum			
Clearingdienst von wesentlicher Systemrelevanz gemäß Artikel 25 Absatz 2c		Zugelassene CCP gemäß Artikel 14	
	Geschäftsgröße (in Mio. EUR)		Geschäftsgröße (in Mio. EUR)
Laufzeit	Alle Geschäftsgrößen	Laufzeit	Alle Geschäftsgrößen
[0-6M]		[0-6M]	
(6M-12M]		(6M-12M]	
(12M-24M]		(12M-24M]	
(24M+]		(24M+]	