

DURCHFÜHRUNGSVERORDNUNG (EU) Nr. 1249/2012 DER KOMMISSION**vom 19. Dezember 2012****zur Festlegung technischer Durchführungsstandards im Hinblick auf das Format der gemäß der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister von zentralen Gegenparteien aufzubewahrenden Aufzeichnungen****(Text von Bedeutung für den EWR)**

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

nach Stellungnahme der Europäischen Zentralbank ⁽¹⁾,gestützt auf die Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. Juli 2012 über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister ⁽²⁾, insbesondere auf Artikel 29 Absatz 5,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Gemäß Artikel 29 Absatz 4 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 sowie den Artikeln 13, 14 und 15 des gemäß Artikel 29 Absatz 4 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 erlassenen delegierten Rechtsakts im Hinblick auf technische Regulierungsstandards, in denen die Einzelheiten der von zentralen Gegenparteien (CCPs) aufzubewahrenden Aufzeichnungen und Informationen festgelegt werden, sollte auch das Format der gemäß diesen Artikeln aufzubewahrenden Aufzeichnungen und Informationen festgelegt werden.
- (2) Damit die einschlägigen Behörden ihre Aufgaben wirkungsvoll und kohärent wahrnehmen können, sollten sie mit Daten versorgt werden, die über CCPs hinweg vergleichbar sind. Die Verwendung einheitlicher Formate erleichtert auch den Datenabgleich zwischen CCPs.
- (3) Da CCPs und Transaktionsregister unter gewissen Umständen dieselben Informationen aufzubewahren oder zu melden haben, sollte eine CCP verpflichtet sein, Daten für Aufzeichnungszwecke in einem Format aufzubewahren, das mit dem von Transaktionsregistern verwendeten Format kompatibel ist. Die Verwendung eines über die verschiedenen Finanzmarktinfrastrukturen hinweg einheitlichen Formats erleichtert die verstärkte Nutzung dieser Formate durch ein breites Spektrum von Marktteilnehmern, wodurch eine Standardisierung gefördert wird.
- (4) Um eine durchgängig automatisierte Abwicklung und Kostensenkungen für die Marktteilnehmer zu erleichtern, ist es wichtig, dass CCP-übergreifend soweit wie möglich standardisierte Verfahren und Datenformate verwendet werden.

- (5) Zur Identifikation des Basiswerts sollte eine einheitliche Kennziffer verwendet werden, doch gibt es derzeit keinen marktweit standardisierten Code zur Identifikation der in einem Korb enthaltenen Basiswerte. CCPs sollten daher zumindest angeben, dass es sich beim Basiswert um einen Korb handelt und für standardisierte Indizes nach Möglichkeit ISIN-Kennziffern (ISIN: International Securities Identification numbers) verwenden.

- (6) Diese Verordnung stützt sich auf den Entwurf technischer Durchführungsstandards, der der Kommission von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) vorgelegt wurde.

- (7) Gemäß Artikel 15 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde) ⁽³⁾ hat die ESMA vor der Vorlage des Entwurfs technischer Durchführungsstandards, auf den sich die vorliegende Verordnung stützt, eine offene öffentliche Konsultation durchgeführt, die damit verbundenen potenziellen Kosten- und Nutzeneffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

*Artikel 1***Formate von Aufzeichnungen**

- (1) Eine CCP bewahrt in dem in Tabelle 1 des Anhangs dargelegten Format für jeden abgewickelten Kontrakt die Aufzeichnungen auf, die in Artikel 20 des gemäß Artikel 29 Absatz 4 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 erlassenen delegierten Rechtsakts im Hinblick auf technische Regulierungsstandards zur Festlegung der Einzelheiten der von zentralen Gegenparteien (CCPs) aufzubewahrenden Aufzeichnungen und Informationen festgelegt sind.

- (2) Eine CCP bewahrt in dem in Tabelle 2 des Anhangs dargelegten Format für jede Position die Aufzeichnungen auf, die in Artikel 21 des gemäß Artikel 29 Absatz 4 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 erlassenen delegierten Rechtsakts im Hinblick auf technische Regulierungsstandards zur Festlegung der Einzelheiten der von zentralen Gegenparteien (CCPs) aufzubewahrenden Aufzeichnungen und Informationen festgelegt sind.

⁽¹⁾ Noch nicht im Amtsblatt veröffentlicht.⁽²⁾ ABl. L 201 vom 27.7.2012, S. 1.⁽³⁾ ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84.

(3) Eine CCP bewahrt in dem in Tabelle 3 des Anhangs dargelegten Format für die mit ihrem Geschäft und ihrer internen Organisation zusammenhängenden Tätigkeiten die Aufzeichnungen auf, die in Artikel 22 des gemäß Artikel 29 Absatz 4 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 erlassenen delegierten Rechtsakts im Hinblick auf technische Regulierungsstandards zur Festlegung der Einzelheiten der von zentralen Gegenparteien (CCPs) aufzubewahrenden Aufzeichnungen und Informationen festgelegt sind.

(4) Eine CCP stellt der zuständigen Behörde die Aufzeichnungen und Informationen nach den Absätzen 1, 2 und 3 in einem

Format zur Verfügung, das einen direkten Datenfeed zwischen der CCP und der zuständigen Behörde ermöglicht. Eine CCP richtet einen solchen Datenfeed auf Antrag der zuständigen Behörde innerhalb von sechs Monaten ein.

Artikel 2

Inkrafttreten

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

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

Brüssel, den 19. Dezember 2012

Für die Kommission
Der Präsident
José Manuel BARROSO

ANHANG

Tabellen mit den nach Maßgabe des Artikels 1 aufbewahrungspflichtigen Datenfeldern

Tabelle 1

Aufzeichnungen über abgewickelte Geschäfte

	Feld	Format	Beschreibung
1	Zeitstempel der Meldung	Datum nach ISO 8601 / UTC-Zeit	Datum und Uhrzeit der Meldung.
2	Preis/Satz	Bis zu 20 numerische Zeichen im Format xxx.xxxxx	Preis pro Wertpapier oder Derivatekontrakt ohne Provisionen und (sofern relevant) Stückzinsen. Bei Schuldtiteln kann der Preis entweder als Währungsbetrag oder als Prozentsatz ausgedrückt werden.
2a	Art der Preisangabe	Z.B. Währung nach ISO 4217, 3 alphabetische Zeichen, Prozentsatz	Art und Weise, wie der Preis ausgedrückt wird.
3	Nennwährung	Währung nach ISO 4217, 3 alphabetische Zeichen	Währung, in der der Preis ausgedrückt wird. Wird der Preis bei einer Schuldverschreibung oder einem sonstigen verbrieften Schuldtitel als Prozentsatz ausgedrückt, ist dieser Prozentsatz anzugeben.
3a	Lieferbare Währung	Währung nach ISO 4217, 3 alphabetische Zeichen	Zu liefernde Währung.
4	Menge	Bis zu 10 numerische Zeichen	Anzahl der Finanzinstrumente, Nennwert der Schuldverschreibungen oder Zahl Derivatekontrakte im Rahmen des betreffenden Geschäfts.
5	Art der Mengenangabe	Bis zu 10 numerische Zeichen	Angabe, ob es sich bei der Menge um die Zahl der Finanzinstrumente, den Nennwert der Schuldverschreibungen oder die Zahl der Derivatekontrakte handelt.
6	CCP-Seite	B = Käufer/S = Verkäufer	
7	Produkt-Identifikation	Vorläufige Taxonomie gemäß den in Artikel 4 der Verordnung (EG) Nr. XX/2012 [Entwurf technischer Durchführungsstandards für Format und Häufigkeit der Transaktionsmeldungen an Handelsregister] enthaltenen Angaben, ISIN oder UPI (Unique Product Identifier)	Sofern verfügbar, Identifikation des Kontrakts durch Angabe einer Produktkennziffer.
8	Identifikation des Clearingmitglieds	Unternehmenskennziffer (LEI) (20 alphanumerische Zeichen), vorläufige Unternehmenskennziffer (20 alphanumerische Zeichen), BIC (11 alphanumerische Zeichen) oder Kundenkennziffer (50 alphanumerische Zeichen).	Ist die meldende Gegenpartei kein Clearingmitglied, ist in diesem Feld die einheitliche Kennziffer des Clearingmitglieds der meldenden Gegenpartei anzugeben. Bei Einzelpersonen ist die von der CCP vergebene Kundenkennziffer anzugeben.

	Feld	Format	Beschreibung
9	Identifikation des Begünstigten	<i>Unternehmenskennziffer (LEI) (20 alphanumerische Zeichen), vorläufige Unternehmenskennziffer (20 alphanumerische Zeichen), BIC (11 alphanumerische Zeichen) oder Kundenkennziffer (50 alphanumerische Zeichen).</i>	Ist der Kontraktbegünstigte keine Kontraktpartei dieses Kontrakts, ist für den Begünstigten eine einheitliche Kennziffer oder - bei Einzelpersonen - die Kundenkennziffer anzugeben, die der Begünstigte von dem von ihm in Anspruch genommenen Unternehmen erhalten hat.
10	Partei, die den Kontrakt übertragen hat (bei Give-up)	<i>Unternehmenskennziffer (LEI) (20 alphanumerische Zeichen), vorläufige Unternehmenskennziffer (20 alphanumerische Zeichen), BIC (11 alphanumerische Zeichen) oder Kundenkennziffer (50 alphanumerische Zeichen).</i>	
11	Ausführungsplatz	<i>Sofern relevant, Market Identifier Code (MIC) nach ISO 10383, bei außerbörslich gehandelten notierten Derivaten XOFF und bei OTC-Derivaten XXXX</i>	Angabe des Platzes, an dem das Geschäft ausgeführt wurde. Bei Abschluss des Kontrakts im Freiverkehr ist anzugeben, ob das betreffende Instrument zwar zum Handel zugelassen, aber außerbörslich gehandelt wurde, oder ob es nicht zum Handel zugelassen und außerbörslich gehandelt wurde.
12	Datum der Zwischenschaltung	<i>Datum nach ISO 8601</i>	Tag, an dem die Zwischenschaltung der CCP in den Kontrakt ausgeführt wurde.
13	Uhrzeit der Zwischenschaltung	<i>UTC-Zeit</i>	Uhrzeit, zu der die Zwischenschaltung der CCP in den Kontrakt ausgeführt wurde. Anzugeben ist die Ortszeit der zuständigen Behörde, der das Geschäft gemeldet wird, und zwar in koordinierter Weltzeit (UTC) +/- Stunden.
14	Datum der Kontraktbeendigung	<i>Datum nach ISO 8601</i>	Tag, an dem die Beendigung des Kontrakts eingetreten ist.
15	Uhrzeit der Vertragsbeendigung	<i>UTC-Zeit</i>	Uhrzeit, zu der die Kontraktbeendigung eingetreten ist. Anzugeben ist die Ortszeit der zuständigen Behörde, der das Geschäft gemeldet wird, und zwar in koordinierter Weltzeit (UTC) +/- Stunden.
16	Art der Lieferung	<i>C = bar, P = stückemäßig, O = optional für Gegenpartei</i>	Angabe, ob der Kontrakt stückemäßig oder bar abgewickelt wird.
17	Abwicklungsdatum	<i>Datum nach ISO 8601</i>	Tag, an dem Abwicklung oder Erwerb des Kontrakts ausgeführt werden. Bei mehreren Daten können weitere Felder angegeben werden.
18	Uhrzeit der Abwicklung oder des Erwerbs des Kontrakts	<i>UTC-Zeit</i>	Uhrzeit, zu der Abwicklung oder Erwerb des Kontrakts ausgeführt werden. Anzugeben ist die Ortszeit der zuständigen Behörde, der das Geschäft gemeldet wird, und zwar in koordinierter Weltzeit (UTC) +/- Stunden.

	Feld	Format	Beschreibung
Angaben zu den Ausgangskonditionen der geclearten Kontrakte, soweit anwendbar			
19	Datum	<i>Datum nach ISO 8601</i>	Tag, an dem der Kontrakt ursprünglich abgeschlossen wurde.
20	Uhrzeit	<i>UTC-Zeit</i>	Uhrzeit, zu der der Ausgangskontrakt ursprünglich abgeschlossen wurde. Anzugeben ist die Ortszeit der zuständigen Behörde, der das Geschäft gemeldet wird, und zwar in koordinierter Weltzeit (UTC) +/- Stunden.
21	Produkt-Identifikation	<i>Vorläufige Taxonomie gemäß den in Artikel 4 der Verordnung (EG) Nr. XX/2012 [Entwurf technischer Durchführungsstandards für Format und Häufigkeit der Transaktionsmeldungen an Handelsregister] enthaltenen Angaben, ISIN oder UPI (Unique Product Identifier)</i>	Sofern verfügbar, Identifikation des Kontrakts durch Angabe einer einheitlichen Produktkennziffer.
22	Basiswert	<i>Einheitliche Produktkennziffer, ISIN (12 alphanumerische Zeichen) und CFI (6 alphanumerische Zeichen). Unternehmenskennziffer (LEI) (20 alphanumerische Zeichen), vorläufige Unternehmenskennziffer (20 alphanumerische Zeichen), B = Korb oder I = Index</i>	Kennziffer des Wertpapiers, das den Basiswert bei einem Derivatekontrakt oder für das übertragbare Wertpapier im Sinne des Artikels 4 Absatz 1 Ziffer 18 Buchstabe c der Richtlinie 2004/39/EG darstellt.
23	Derivatetyp (bei Derivatekontrakten)	Harmonisierte Beschreibung des Derivatetyps durch Angabe einer in einer einheitlichen, international anerkannten Finanzinstrumente-Klassifizierung enthaltenen Oberkategorie	
24	Aufnahme des Finanzinstruments in das ESMA-Register der clearingpflichtigen Kontrakte (bei Derivatekontrakten)	<i>Y = Ja/N = Nein</i>	
Sonstige Angaben, soweit anwendbar			
25	Angabe der interoperablen CCP, die eine Phase des Geschäfts clear	<i>Unternehmenskennziffer (LEI) (20 alphanumerische Zeichen), vorläufige Unternehmenskennziffer (20 alphanumerische Zeichen), BIC (11 alphanumerische Zeichen) oder Kundenkennziffer (50 alphanumerische Zeichen).</i>	

Tabelle 2

Aufzeichnungen über Positionen

	Feld	Format
1	Identifikation des Clearingmitglieds	Unternehmenskennziffer (LEI), vorläufige Unternehmenskennziffer oder BIC
2	Identifikation des Begünstigten	Unternehmenskennziffer (LEI), vorläufige Unternehmenskennziffer, BIC oder Kundenkennziffer
3	Interoperable CCP, die die Position hält	Unternehmenskennziffer (LEI), vorläufige Unternehmenskennziffer, BIC oder Kundenkennziffer
4	Zeichen der Position	B = Käufer/S = Verkäufer
5	Wert der Position	Bis zu 10 numerische Zeichen (xxxx,yy)
6	Preis, zu dem die Kontrakte bewertet sind	Bis zu 10 numerische Zeichen (xxxx,yy)
7	Währung	ISO-Währungscode
8	Andere relevante Informationen	Freier Text
9	Betrag der von der CCP eingeforderten Einschusszahlungen (Margins)	Bis zu 10 numerische Zeichen (xxxx,yy)
10	Betrag der von der CCP eingeforderten Beiträge zum Ausfallfonds	Bis zu 10 numerische Zeichen (xxxx,yy)
11	Betrag anderer von der CCP eingeforderter Finanzmittel	Bis zu 10 numerische Zeichen (xxxx,yy)
12A	Betrag der vom Clearingmitglied unter Bezugnahme auf Kundenkonto A geleisteten Einschusszahlungen	Bis zu 10 numerische Zeichen (xxxx,yy)
13A	Betrag der vom Clearingmitglied unter Bezugnahme auf Kundenkonto A geleisteten Beiträge zum Ausfallfonds	Bis zu 10 numerische Zeichen (xxxx,yy)
14A	Betrag der sonstigen vom Clearingmitglied unter Bezugnahme auf Kundenkonto A zur Verfügung gestellten Finanzmittel	Bis zu 10 numerische Zeichen (xxxx,yy)
15B	Betrag der vom Clearingmitglied unter Bezugnahme auf Kundenkonto B geleisteten Einschusszahlungen	Bis zu 10 numerische Zeichen (xxxx,yy)
16B	Betrag der vom Clearingmitglied unter Bezugnahme auf Kundenkonto B geleisteten Beiträge zum Ausfallfonds	Bis zu 10 numerische Zeichen (xxxx,yy)
17B	Betrag der sonstigen vom Clearingmitglied unter Bezugnahme auf Kundenkonto B zur Verfügung gestellten Finanzmittel	Bis zu 10 numerische Zeichen (xxxx,yy)

Tabelle 3

Geschäftliche Aufzeichnungen

	Feld	Format	Beschreibung
1	Organisationspläne	<i>Freier Text</i>	Board und relevante Ausschüsse, Clearing-Abteilung, Risikomanagement-Abteilung sowie alle anderen relevanten Abteilungen oder Unterabteilungen.

Anteilseigner oder Gesellschafter, die eine qualifizierte Beteiligung halten (für jeden relevanten Anteilseigner/Gesellschafter ist ein Feld hinzuzufügen)

2	Eigenschaft	<i>S = Anteilseigner / M = Gesellschafter</i>	
3	Art der qualifizierten Beteiligung	<i>D = direkt / I = indirekt</i>	
4	Art der Person	<i>N = natürliche Person / L = juristische Person</i>	
5	Betrag der Beteiligung	<i>Bis zu 10 numerische Zeichen (xxxx,yyyy)</i>	

Sonstige Unterlagen

6	Im Rahmen organisationsbezogener Anforderungen vorgeschriebene Strategien, Verfahren und Prozesse	<i>Unterlagen</i>	
7	Protokolle der Board-Sitzungen, der Sitzungen von Unterausschüssen (falls anwendbar) und von Ausschüssen der Geschäftsleitung (falls anwendbar)	<i>Unterlagen</i>	
8	Protokolle der Sitzungen des Risikoausschusses	<i>Unterlagen</i>	
9	Protokolle der Sitzungen der Konsultationsgruppe mit Clearingmitgliedern und Kunden (falls vorhanden)	<i>Unterlagen</i>	
10	Berichte von internen und externen Prüfern, Risikomanagement-Funktion, Compliance-Funktion und Beratern	<i>Unterlagen</i>	
11	Geschäftsfortführungsstrategie und Notfallwiederherstellungsplan	<i>Unterlagen</i>	
12	Liquiditätsplan und tägliche Liquiditätsberichte	<i>Unterlagen</i>	
13	Unterlagen über sämtliche Vermögenswerte und Verbindlichkeiten sowie Kapitalkonten	<i>Unterlagen</i>	

	Feld	Format	Beschreibung
14	Eingegangene Beschwerden	<i>Freier Text</i>	Für jede Beschwerde: Angaben zu Namen, Anschrift und Kontonummer des Beschwerdeführers; Datum des Beschwerdeeingangs; Namen aller in der Beschwerde genannter Personen; Beschreibung der Art der Beschwerde; Maßnahmen zur Beilegung der Beschwerde; Datum, an dem die Beschwerde beigelegt wurde.
15	Angaben zu Dienstunterbrechungen oder Funktionsstörungen	<i>Freier Text</i>	Angaben zu etwaigen Dienstunterbrechungen oder Funktionsstörungen, mit ausführlichen Angaben zu Zeitabfolge, Auswirkungen und Abhilfemaßnahmen.
16	Ergebnisse durchgeführter Backtests und Stresstests	<i>Freier Text</i>	
17	Schriftverkehr mit zuständigen Behörden, ESMA und einschlägigen Mitgliedern des ESZB	<i>Unterlagen</i>	
18	Gemäß organisationsbezogener Anforderungen erhaltene Rechtsgutachten	<i>Unterlagen</i>	
19	Interoperabilitätsvereinbarungen mit anderen CCP (falls anwendbar)	<i>Unterlagen</i>	
20	Liste sämtlicher Clearingmitglieder (Artikel 17 der Verordnung (EU) Nr. XXX/2012)	<i>Freier Text/Dokument</i>	Liste gemäß Artikel 17 der Verordnung (EU) Nr. XXX/2012.
21	Angaben gemäß Artikel 17 der Verordnung (EU) Nr. XXX/2012.	<i>Freier Text/Dokumente</i>	Gesetze und Vorschriften betreffend (i) den Zugang zur CCP, (ii) die Verträge der CCP mit den Clearingmitgliedern und, wenn praktisch durchführbar, den Kunden, (iii) die von der CCP für das Clearing akzeptierten Kontrakte, (iv) etwaige Interoperabilitätsvereinbarungen, (v) die Verwendung von Sicherheiten und Ausfallfonds-Beiträgen, einschließlich Auflösung von Positionen und Sicherheiten sowie Umfang, in dem Sicherheiten vor Ansprüchen Dritter geschützt sind (Grad der Trennung).
22	Entwicklungen bei neu initiierten Prozessen	<i>Freier Text</i>	Beim Angebot neuer Dienste.