



# Richtlinien zur Geldmarktstatistik

Gültig ab: 01.07.2024

<b>1.</b>	<b>EINLEITUNG</b> .....	<b>4</b>
<b>2.</b>	<b>ALLGEMEINE ANFORDERUNGEN</b> .....	<b>5</b>
<b>2.1</b>	<b>Gegenstand der Erhebung</b> .....	<b>5</b>
2.1.1	Kreis der Berichtspflichtigen .....	5
2.1.2	Geldmarktsegmente .....	7
2.1.3	Umfang der Berichterstattung .....	8
2.1.4	Wesentlichkeitsschwellenwert (Materiality Threshold) .....	9
<b>2.2</b>	<b>Anforderungen an die Datenübertragung</b> .....	<b>10</b>
2.2.1	Aktualität und Exaktheit .....	10
2.2.2	Datenübertragung .....	11
2.2.3	Unique Transaction Identifier .....	11
2.2.4	Korrekturen .....	12
2.2.5	Neuverhandlungen .....	14
2.2.6	Life-Cycle-Events .....	14
2.2.7	Novationen .....	15
<b>2.3</b>	<b>Konzeptionelle Struktur der Meldung zur Geldmarktstatistik</b> .....	<b>16</b>
2.3.1	Konzeptionelle Struktur des Business Application Header .....	17
2.3.2	Konzeptionelle Struktur des Reporting Header .....	18
2.3.3	Felddefinitionen für den Header in allen Segmenten .....	18
2.3.4	Konzeptionelle Definitionen in allen Reporting Messages der Geldmarktstatistik .....	19
2.3.5	Felddefinitionen für Daten aller Marktsegmente .....	20
<b>3.</b>	<b>KONZEPTIONELLE UND FELDDEFINITIONEN FÜR DAS BESICHERTE MARKTSEGMENT</b> .....	<b>20</b>
<b>3.1</b>	<b>Tri-Party-General-Collateral-Geschäfte</b> .....	<b>21</b>
<b>3.2</b>	<b>Meldung von Open Repos, kündbaren Fixed-Term Repos, Evergreen und Extendible Repos</b> .....	<b>22</b>
<b>3.3</b>	<b>Meldung von Wertpapierleihgeschäften, die wirtschaftlich äquivalent zu Repogeschäften sind</b> .....	<b>29</b>
<b>3.4</b>	<b>Variablen im besicherten Marktsegment</b> .....	<b>33</b>
<b>3.5</b>	<b>Felddefinitionen für das besicherte Marktsegment (Tabelle 1)</b> .....	<b>42</b>
<b>4.</b>	<b>KONZEPTIONELLE UND FELDDEFINITIONEN FÜR DAS UNBESICHERTE MARKTSEGMENT</b> .....	<b>47</b>
<b>4.1</b>	<b>Referenztablelle zu meldepflichtigen Instrumenten im unbesicherten Marktsegment</b> .....	<b>47</b>
<b>4.2</b>	<b>Meldung von Tagesgeldkonten und Sparkonten</b> .....	<b>49</b>
<b>4.3</b>	<b>Primärmarkt</b> .....	<b>51</b>
<b>4.4</b>	<b>Erläuterungen der zu meldenden Variablen im unbesicherten Segment</b> .....	<b>51</b>
<b>4.5</b>	<b>Felddefinitionen für das unbesicherte Marktsegment (Tabelle 2)</b> .....	<b>57</b>
<b>5.</b>	<b>KONZEPTIONELLE UND FELDDEFINITIONEN FÜR DEVISENSWAPGESCHÄFTE</b> .....	<b>61</b>

5.1	Konzeptionelle Definitionen.....	61
5.2	Felddefinitionen für Daten zu Devisenswapgeschäften (Tabelle 3).....	65
6.	<b>KONZEPTIONELLE UND FELDDEFINITIONEN FÜR OVERNIGHT INDEX SWAPS (TAGESGELDSATZ-SWAPGESCHÄFTE)</b> .....	69
6.1	Konzeptionelle Definitionen.....	69
6.2	Felddefinitionen für Daten zu Overnight Index Swaps (Tabelle 4) .....	72
	<b>ANHANG I: CODELISTEN</b> .....	76
	<b>ANHANG II: DATA QUALITY CHECKS</b> .....	79
	<b>ANHANG III: ZUORDNUNG ZWISCHEN NAMEN VON VARIABLEN IN DEN RICHTLINIEN UND DER VERORDNUNG</b> .....	81
	<b>ANHANG IV: LISTE VON ISIN-CODES FÜR REFERENZZINSSÄTZE</b> .....	82
	<b>ANHANG V: LISTE DER SUPRANATIONALEN ORGANISATIONEN</b> .....	83
	<b>ANHANG VI: LISTE DER MULTIPLIKATOREN ZUR BERECHNUNG DER FX FORWARD POINTS</b> .....	84
	<b>ANHANG VII: BEISPIELE</b> .....	85
	<b>Besichertes Marktsegment</b> .....	85
	Beispiel 1: Repo-Geschäft .....	85
	Beispiel 2: Darstellung des obigen Beispiels in XML .....	87
	Beispiel 3: Reverse Repo-Transaktion (Umgekehrtes Repo-Geschäft) .....	88
	<b>Unbesichertes Marktsegment</b> .....	90
	Beispiel 4: Einlage .....	90
	Beispiel 5: Darstellung des obigen Beispiels in XML .....	91
	Beispiel 6: Einlage .....	93
	Beispiel 7: Tagesgeldkonto .....	94
	Beispiel 8: Tagesgeldkonto mit einer Kündigungsfrist von 30 Tagen.....	95
	Beispiel 9: Commercial Paper .....	97
	Beispiel 10: Wandelanleihe .....	98
	<b>Segment Devisenswapgeschäfte</b> .....	100
	Beispiel 11: Devisenswapgeschäft.....	100
	Beispiel 12: Darstellung des obigen Beispiels in XML .....	101
	<b>Segment Overnight Index Swaps</b> .....	102
	Beispiel 13: Overnight Index Swaps.....	102
	Beispiel 14: Darstellung des obigen Beispiels in XML .....	103

# 1. Einleitung

Ziele der Geldmarktstatistik (Money Market Statistical Reporting, kurz MMSR) sind:

1. besseres Verständnis und zeitnahe Überwachung des Funktionierens von Geldmärkten im Allgemeinen und der Bankenfinanzierung in verschiedenen Segmenten im Besonderen;
2. bessere und aktuellere Informationen über den geldpolitischen Transmissionsmechanismus sowie verbesserte Informationen über die Markterwartung bezüglich der zukünftigen Entwicklung der Leitzinsen;
3. Bereitstellung zusätzlicher Informationen über das Funktionieren der Geldmärkte an die Marktteilnehmer.

Dieses Dokument beschreibt das standardisierte Melderahmenwerk, das für die tägliche Meldung von Geldmarktstatistikdaten gilt, die durch die Verordnung (EU) Nr. 1333/2014 der Europäischen Zentralbank (EZB/2014/48)<sup>1</sup> (nachfolgend die „Verordnung“) in der durch die Verordnung EZB/2015/30, Verordnung EZB/2018/33, Verordnung EZB/2019/29 und Verordnung EZB/2020/58<sup>2</sup> geänderten Fassung vorgeschrieben wird. Dieses Melderahmenwerk umfasst das Rahmenwerk für die Meldedateien, Berichts- (Meldedateien-)Schemata, Variablen sowie Wertebereiche für diese Variablen, die von den Berichtspflichtigen bei der Meldung von Geldmarkttransaktionen zu verwenden sind.

Der Gesamtdatensatz basiert auf den von den Berichtspflichtigen nach dem „transaction-by-transaction“-Prinzip gemeldeten und in diesem Dokument näher spezifizierten Daten zu Transaktionen mit finanziellen Kapitalgesellschaften (mit Ausnahme von Zentralbanken, wenn die Transaktion mit geldpolitischen Operationen des Eurosystems bzw. ständigen Fazilitäten im Zusammenhang steht), dem Staat sowie mit nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, die nach dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk als „Großkunden“ gelten<sup>3</sup>.

Dieses Dokument ist wie folgt aufgebaut: Kapitel 2 enthält die allgemeinen Anforderungen für alle Marktsegmente. In Kapitel 3 werden die ausführlichen Anforderungen für das besicherte Segment beschrieben und Kapitel 4 behandelt das unbesicherte Marktsegment. In Kapitel 5 wird das Marktsegment Devisenswapgeschäfte beschrieben und in Kapitel 6 das Marktsegment der Overnight Index Swaps (OIS). ANHANG I enthält Code-Listen für Variablen mit einer endlichen Anzahl möglicher Werte. In ANHANG II werden die Data Quality Checks beschrieben, die auf die übermittelten Daten angewendet werden, um ihre Qualität und Konsistenz zu überprüfen. Es wird empfohlen, dass Berichtspflichtige ähnliche Plausibilitätsprüfungen in ihrem System implementieren, um die Qualität ihrer Daten zu verbessern und so mögliche nachträgliche Korrekturen der Daten zu vermeiden. ANHANG III enthält einen Überblick über die Zuordnung zwischen den Bezeichnungen einiger Variablen in den Richtlinien im Vergleich zu ihren jeweiligen Feldern in der Verordnung in Fällen, in denen diese Bezeichnungen nicht identisch sind. ANHANG IV beinhaltet eine Liste von ISIN-Codes für Referenzzinssätze. ANHANG V wurde gestrichen, aber aus Gründen der Nummerierung beibehalten.

<sup>1</sup> Verordnung (EU) Nr. 1333/2014 der EZB vom 26. November 2014 über Geldmarktstatistiken (EZB/2014/48) (ABI. L 359 vom 16.12.2014, S. 97).

<sup>2</sup> Dieses Dokument soll Berichtspflichtigen Hilfestellung bei der Übermittlung der Geldmarktstatistik bieten. Die Begriffsbestimmungen und der rechtliche Rahmen für die Meldung sind in der Verordnung dargelegt.

<sup>3</sup> Weitere Einzelheiten enthalten die Absätze 86 und 90 von *Basel III: Mindestliquiditätsquote und Instrumente zur Überwachung des Liquiditätsrisikos* (2013), in denen „unbesicherte Großkundenmittel“ definiert ist. Das Dokument kann auf der Website der Bank für Internationalen Zahlungsausgleich unter [www.bis.org](http://www.bis.org) abgerufen werden.

ANHANG VI enthält eine Tabelle mit den anwendbaren Multiplikatoren für die Berechnung der FX Forward Points (Swap-Punkte bei Devisenswapgeschäften). ANHANG VII enthält Beispiele für Meldungen für alle Marktsegmente.

Wenn Änderungen an den MMSR Reporting Instructions bzw. an diesem Dokument erforderlich sind, werden diese mittels eines spezifischen Change-Management-Prozesses eingeführt. Dieses Verfahren deckt den gesamten Prozess der Änderung der MMSR Reporting Instruction bzw. der Richtlinien zur Geldmarktstatistik ab, von der anfänglichen Anfrage bzgl. einer Änderung bis zu der Umsetzung der Überarbeitung in den Reporting Instructions und den Richtlinien, der Kommunikation der Überarbeitung an die Stakeholder und der Meldung der Geldmarktstatistikdaten auf Basis der überarbeiteten Reporting Instructions bzw. Richtlinien. Dieser Prozess lässt sich anhand der folgenden Schritte definieren:

Schritt 1. Initiierung einer Änderung – durch ein beliebiges Mitglied des Eurosystems, auch auf Anfrage eines Berichtspflichtigen (der an die EZB oder die betreffende NZB übersandt werden kann);

Schritt 2. Beurteilung des Änderungsanfrage durch die EZB und NZBen;

Schritt 3. Zustimmung zur (oder Ablehnung der) Umsetzung und Überarbeitung der Reporting Instructions bzw. der Richtlinien zur Geldmarktstatistik;

Schritt 4. Technische Folgemaßnahmen und formelle Mitteilung an das Eurosystem und den Kreis der Berichtspflichtigen.

## **2. Allgemeine Anforderungen**

### **2.1 Gegenstand der Erhebung**

#### **2.1.1 Kreis der Berichtspflichtigen**

Ausgehend vom Gesamtbetrag ihrer wesentlichen Bilanzaktiva ist gemäß Artikel 1 und 2 der Verordnung eine ausgewählte Teilgruppe der monetären Finanzinstitute (MFIs) des Euro-Währungsgebiets, einschließlich aller ihrer Zweigniederlassungen in der Europäischen Union und in Staaten der Europäischen Freihandelsassoziation (EFTA) sowie ihrer Zweigniederlassungen im Vereinigten Königreich, verpflichtet, Geldmarktstatistikdaten entweder an ihre betreffenden Nationalen Zentralbanken (NZBen) oder an die Europäische Zentralbank (EZB) zu melden. Die betreffende NZB oder die EZB informiert die MFIs, die der Berichtspflicht zur Geldmarktstatistik unterliegen, schriftlich über ihre Meldepflichten und die Berichtspflichtigen haben die in diesem Dokument aufgeführten Meldepflichten einzuhalten. Die EZB und/oder die betreffende NZB stellen diesen MFIs Informationen zur Verfügung, wie die Erfüllung ihrer Berichtspflichten zur erfolgen hat.

Seit dem 1. April 2016 verlangt die EZB von 53 MFIs des Euro-Währungsgebiets aus der Gruppe der MFIs mit einem Gesamtbetrag der wesentlichen Bilanzaktiva von mehr als 0,35 % des Gesamtbetrags der wesentlichen Bilanzaktiva aller MFIs des Euro-Währungsgebiets, einschließlich ihrer Zweigniederlassungen in der Union und den Staaten der Europäischen Freihandelsassoziation (EFTA) sowie ihrer Zweigniederlassungen im Vereinigten Königreich, Daten über Geldmarkttransaktionen zu melden. Es gab einen dreimonatigen Übergangszeitraum

zur schrittweisen Einführung der Meldung zur Geldmarktstatistik (MMSR) bei den ausgewählten Instituten, der vom 1. April 2016 bis zum 30. Juni 2016 andauerte.

Seit dem 1. Januar 2017 kann der EZB-Rat beschließen, die Liste der Berichtspflichtigen zu erweitern, indem er auch andere Kriterien wie die Bedeutung der MFI-Aktivitäten im Geldmarktsegment und die Bedeutung des MFI für die Stabilität und die Funktionsfähigkeit des Finanzsystems berücksichtigt. Im April 2023 beschloss die EZB, den Kreis der Berichtspflichtigen für die Geldmarktstatistik (MMSR) gemäß Artikel 2 Absatz 3 der Verordnung auf Basis von drei kumulativen Kriterien um 24 neue Berichtspflichtige zu erweitern:

- (i) Gesamtbetrag der wesentlichen Bilanzaktiva von mehr als 0,08 % des Gesamtbetrags der wesentlichen Bilanzaktiva aller MFIs des Euro-Währungsgebiets laut den der EZB zum betreffenden Zeitpunkt zur Verfügung stehenden aktuellen Daten, d. h. Daten in Bezug auf den Durchschnitt der wesentlichen Bilanzaktiva des Berichtspflichtigen bzw. aller MFIs des Euro-Währungsgebiets im Zeitraum Januar bis Dezember 2022. Bei der Berechnung des Gesamtbetrags der wesentlichen Bilanzaktiva werden Zweigniederlassungen außerhalb des Sitzlandes der neuen Berichtspflichtigen nicht berücksichtigt.
- (ii) Bedeutende Tätigkeit an den Geldmärkten, da sie laut den der EZB zum betreffenden Zeitpunkt zur Verfügung stehenden aktuellen Daten (für den Zeitraum Januar bis Dezember 2022) (a) gemessen am Gesamtnennwert aller Geldmarkttransaktion in den vier unter die Verordnung fallenden Geldmarktsegmenten zu den 95 bedeutendsten Banken des Euro-Währungsgebiets zählen und (b) im Tagesdurchschnitt mindestens drei Transaktionen in den vier unter die Verordnung fallenden Geldmarktsegmenten handeln.
- (iii) Bedeutung für die Stabilität und die Funktionsfähigkeit des Finanzsystems im Euro-Währungsgebiet und/oder in einzelnen Mitgliedstaaten, da sie zu den aktuell global systemrelevanten Instituten (G-SIIs) oder anderen systemrelevanten Instituten (O-SIIs) gemäß der Veröffentlichung der Europäischen Bankenaufsichtsbehörde (European Banking Authority) vom Dezember 2022 bzw. 2021 zählen.

Die neuen im April 2023 ausgewählten Berichtspflichtigen melden Daten seit dem 1. Juli 2024.

Der EZB-Rat kann auch beschließen, dass für jeden Mitgliedstaat des Euro-Währungsgebiets mindestens drei MFIs als Berichtspflichtige benannt werden. NZBen können zusätzliche Daten von anderen MFIs auf Grundlage ihrer nationalen statistischen Anforderungen erheben. Werden MFIs anhand dieses Kriteriums ausgewählt, beginnt die Meldung im Rahmen dieser Verordnung an dem Tag, der dem MFI von der betreffenden NZB oder der EZB mitgeteilt wird, keinesfalls jedoch früher als zwölf Monate nach dem Erlass des Beschlusses des EZB-Rats.

Die Meldung von Geldmarktstatistikdaten muss täglich unter Verwendung eines zuvor festgelegten Meldeschemas, das den MFIs von der EZB zur Verfügung gestellt wird, erfolgen.

Die Meldung findet auf der Ebene von Rechtsträgern für alle Zweigniederlassungen in der Union und den EFTA-Staaten sowie für Zweigniederlassungen im Vereinigten Königreich statt. Unterschiedliche Rechtsträger, die Teil derselben Bankengruppen sind, müssen, falls sie auf der Liste der Berichtspflichtigen aufgeführt sind, eine gesonderte Meldung abgeben, sofern keine Delegierung der Berichtspflichten vereinbart wird. In diesem Fall kann ein Berichtspflichtiger die Daten für alle Tochterunternehmen melden, dies jedoch in gesonderten Dateien für die einzelnen Rechtsträger.

Die EZB pflegt die maßgeblichen Codelisten, das Datenwörterbuch und das Meldeschema, die für die Meldung zu verwenden sind, und die EZB oder die entsprechende NZB leitet sie den MFIs zu. Die MFIs müssen alle verfügbaren Meldesätze für bestehende Transaktion melden.

## 2.1.2 Geldmarktsegmente

Die folgenden vier Geldmarktsegmente sind durch die Geldmarktstatistik abgedeckt:

- (a) tägliche Repogeschäfte mit fester Laufzeit und Bis-auf-Weiteres-Repogeschäfte (BAW-Repogeschäfte), Sell/Buy-Back-Transaktionen sowie bestimmte Wertpapierleihen, die wirtschaftlich äquivalent zu Repogeschäften sind, die auf Euro lauten und eine Laufzeit von bis zu und einschließlich einem Jahr (definiert als Transaktionen mit einer Laufzeit von nicht mehr als 397 Tagen nach dem Abwicklungstag) aufweisen, die von dem Berichtspflichtigen mit finanziellen Kapitalgesellschaften (mit Ausnahme von Zentralbanken, wenn die Transaktion mit geldpolitischen Operationen des Eurosystems bzw. ständigen Fazilitäten im Zusammenhang steht), dem Staat sowie mit nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, die nach dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk als „Großkunden“ gelten, durchgeführt werden;
- (b) tägliche unbesicherte Transaktionen, die Folgendes abdecken:
  - (i) alle auf Euro lautenden Geldaufnahmen mit einer Laufzeit von bis zu und einschließlich einem Jahr (definiert als Transaktionen mit einer Laufzeit von nicht mehr als 397 Tagen nach dem Abwicklungstag), die von dem Berichtspflichtigen mit finanziellen Kapitalgesellschaften (mit Ausnahme von Zentralbanken, sofern die Transaktion nicht zu Investitionszwecken dient), dem Staat sowie mit nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, die nach dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk als „Großkunden“ gelten, unter Einsatz der in der Verordnung definierten Instrumente, die insbesondere unbesicherte Einlagen, Tagesgeldkonten und die Emission von kurzfristigen Schuldverschreibungen (definiert als Transaktionen mit einer Laufzeit von nicht mehr als 397 Tagen nach dem Abwicklungstag) mit fester oder variabler Verzinsung abdecken, durchgeführt werden;
  - (ii) alle auf Euro lautenden Geldvergaben an andere Kreditinstitute mit einer Laufzeit von bis zu und einschließlich einem Jahr (definiert als Transaktionen mit einer Laufzeit von nicht mehr als 397 Tagen nach dem Abwicklungstag) über unbesicherte Einlagen oder Tagesgeldkonten oder über den Kauf von kurzfristigen Schuldverschreibungen von den emittierenden Kreditinstituten mit fester oder variabler Verzinsung mit einer anfänglichen Laufzeit von bis zu und einschließlich einem Jahr (definiert als Transaktionen mit einer Laufzeit von nicht mehr als 397 Tagen nach dem Abwicklungstag);
- (c) tägliche Devisenswappeschäfte mit einer Laufzeit von bis zu und einschließlich einem Jahr (definiert als Transaktionen mit einer Laufzeit von nicht mehr als 397 Tagen nach dem Abwicklungstag), bei denen Euro zu einem Valutatag in naher Zukunft gegen eine Fremdwährung mit der Verpflichtung gekauft bzw. verkauft werden, die gekaufte Fremdwährung zu einem im Voraus vereinbarten zukünftigen Zeitpunkt wieder zu verkaufen, die von dem Berichtspflichtigen mit finanziellen Kapitalgesellschaften (mit Ausnahme von Zentralbanken, wenn die Transaktion mit geldpolitischen Operationen des Eurosystems

- im Zusammenhang steht), dem Staat sowie mit nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, die nach dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk als „Großkunden“ gelten, durchgeführt werden;
- (d) auf Euro lautende Overnight Index Swaps (OIS) mit beliebiger Laufzeit<sup>4</sup>, die mit finanziellen Kapitalgesellschaften (mit Ausnahme von Zentralbanken, sofern die Transaktion nicht zu Investitionszwecken dient), dem Staat sowie mit nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, die nach dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk als „Großkunden“ gelten, durchgeführt werden.

### 2.1.3 Umfang der Berichterstattung

Berichtspflichtige sind verpflichtet, täglich statistische Informationen über Geldmarktinstrumente an die NZB des Mitgliedstaats, in dem sie ihren Sitz haben, oder alternativ an die EZB zu melden. Die Meldung muss alle Transaktionen im Zusammenhang mit Geldmarktinstrumenten umfassen, die in ihren Zweigniederlassungen in der Europäischen Union und in EFTA-Staaten sowie in ihren Zweigniederlassungen im Vereinigten Königreich gebucht werden.

Der Hauptsitz des Berichtspflichtigen sollte die Meldung für alle Zweigniederlassungen in der EU und in EFTA-Staaten sowie für Zweigniederlassungen im Vereinigten Königreich vornehmen, indem er die von diesen Zweigniederlassungen durchgeführten Geschäfte in seine Meldungen aufnimmt. Für die Meldung zur Geldmarktstatistik ist es von Bedeutung, wo eine Transaktion gebucht wird (auf der Ebene des Berichtspflichtigen, in allen seinen Zweigniederlassungen in der Europäischen Union und den EFTA-Staaten sowie in Zweigniederlassungen im Vereinigten Königreich) und nicht, wo die Transaktion veranlasst bzw. ausgeführt wird.

Beispielsweise müssen bei einem französischen Kreditinstitut mit Zweigniederlassungen auf der ganzen Welt die folgenden Transaktionen gemeldet werden<sup>5</sup>:

Veranlassung der Transaktion (in Euro)	Buchung der Transaktion in	Meldepflicht des französischen Instituts?
Zweigniederlassung in Hongkong	Hongkong	Nein
Zweigniederlassung in Hongkong	Paris	Ja
Zweigniederlassung in Paris	Paris	Ja
Zweigniederlassung in Paris	Stockholm	Ja
Zweigniederlassung in Paris	New York	Nein
Zweigniederlassung in Stockholm	Stockholm	Ja
Zweigniederlassung in Stockholm	Paris	Ja
Zweigniederlassung in New York	New York	Nein

<sup>4</sup> Bei OIS richtet sich die Einstufung als Geldmarktinstrument nach der Laufzeit des Basiswerts, unabhängig von der Endfälligkeit des OIS.

<sup>5</sup> Die Beispiele beziehen sich auf die derzeitigen EU- und EFTA-Staaten sowie die Zweigniederlassungen im Vereinigten Königreich und könnten Änderungen unterliegen.

Veranlassung der Transaktion (in Euro)	Buchung der Transaktion in	Meldepflicht des französischen Instituts?
Zweigniederlassung in New York	Paris	Ja
Zweigniederlassung in London	Paris	Ja
Zweigniederlassung in London	London	Ja
Zweigniederlassung in London	New York	Nein

Gruppeninterne Transaktionen unterliegen keiner Meldepflicht. „Gruppe“ und „gruppeninterne Transaktionen“ sind im ersten Erwägungsgrund und in den Absätzen 15 und 19 von Artikel 1 der Verordnung EZB/2014/48 definiert. Artikel 1 Absatz 19 enthält eine eindeutige Begriffsbestimmung von gruppeninternen Transaktionen, nämlich Transaktionen zwischen zwei verschiedenen Rechtsträgern, die auf Grundlage der Internationalen Rechnungslegungsstandards (IFRS) oder einer aufsichtsrechtlichen Konsolidierung gemäß der Verordnung Teil derselben Gruppe sind.

Konsolidierung ist in Übereinstimmung mit der Richtlinie 2013/34/EU – d. h. CRD IV – definiert, wonach zwei mögliche Konsolidierungskreise nach CRD IV existieren:

- (a) ein engerer Konsolidierungskreis,
- (b) ein erweiterter Konsolidierungskreis.

Der für die Geldmarktstatistik relevante Konsolidierungskreis ist der erweiterte, d. h. Transaktionen innerhalb dieses Konsolidierungskreises sind im Rahmen der der Geldmarktstatistik (MMSR) nicht meldepflichtig.

## 2.1.4 Wesentlichkeitsschwellenwert (Materiality Threshold)

Transaktionen mit nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften (NFCs) sind zu melden; hiervon ausgenommen sind Transaktionen mit NFCs, die als „Kleinunternehmen“ („small business customers“) definiert sind und als „Privatkundeneinlage“ („retail deposits“) gemäß Absatz 86 und 90 des Basel-III-LCR-Rahmenwerks und Artikel 411 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013<sup>6</sup> gelten.

In der Verordnung wird auf das LCR-Rahmenwerk Bezug genommen, um einen statistischen Wesentlichkeitsschwellenwert festzulegen, unterhalb dessen Transaktionen nicht zu melden sind. Der Verweis auf das LCR-Rahmenwerk ist daher mit Blick auf die objektiven Kriterien zu verstehen, die das Rahmenwerk für die standardmäßige Klassifizierung von Kunden als „Privatkunden“ („retail“) vorgibt und die auf die statistische Wesentlichkeit ihrer Transaktionen abstellen. Entscheidungen des Berichtspflichtigen bei der Umsetzung des LCR-Rahmenwerks im Hinblick auf die freiwillige Klassifizierung zusätzlicher Gegenparteien als „Großkunden“

<sup>6</sup> Verordnung (EU) Nr. 575/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 26. Juni 2013 über Aufsichtsanforderungen an Kreditinstitute und Wertpapierfirmen und zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (ABl. L 176 vom 27.06.2013, S. 1).

für aufsichtliche Zwecke sollten keine Auswirkung auf die Wesentlichkeit für die Zwecke der Meldung im Rahmen der Verordnung haben.

Darüber hinaus sind zur weiteren effizienten Operationalisierung der Meldungen Transaktionen mit einem Nennwert unter 500.000 EUR nicht meldepflichtig. Diese Meldegrenze gilt für alle Transaktion in allen Geldmarktsegmenten unabhängig vom Sektor der Gegenpartei.

## **2.2 Anforderungen an die Datenübertragung**

### **2.2.1 Aktualität und Exaktheit**

Die Meldung zur Geldmarktstatistik ist für alle Institute, die ihre Meldung bei der Deutschen Bundesbank einreichen müssen, täglich bis spätestens 6:30 Uhr Mitteleuropäischer Zeit (MEZ) des ersten auf den Handelstag folgenden TARGET2-Handelstag abzugeben.

Entscheidet eine NZB, dass Berichtspflichtige direkt an die EZB zu melden haben, müssen die Berichtspflichtigen die betreffenden Informationen einmal pro Tag zwischen 18.00 Uhr des Handelstages und 7.00 Uhr Mitteleuropäischer Zeit (MEZ)<sup>7</sup> des ersten auf den Handelstag folgenden TARGET2-Handelstag übertragen.

In allen anderen Fällen als dem im vorstehenden Absatz beschriebenen übertragen die jeweiligen NZBen die täglichen Geldmarktstatistikdaten, die sie von den Berichtspflichtigen erhalten, einmal pro Tag vor 7.00 Uhr Mitteleuropäischer Zeit (MEZ) des ersten auf den Handelstag folgenden TARGET2-Handelstag an die EZB.

Werden an einem bestimmten Tag keine Transaktionen gebucht, hat der Berichtspflichtige eine leere Datei zu übertragen und den Status der Meldung anzugeben, wie dies in den nachstehenden Abschnitten näher beschrieben ist.

Bei der Durchführung der Schritte zur Sicherstellung der Datenqualität, die in der Methodik der Euro Short-Term Rate beschrieben sind und im Rahmen der Prozesse zur Sicherstellung der Datenqualität der Geldmarktstatistik auf die von den Berichtspflichtigen gemeldeten Daten angewendet werden, ist es von essenzieller Wichtigkeit, dass sich die EZB oder die betreffende NZB darauf verlassen kann, dass die Berichtspflichtigen zeitnah auf jegliche Kommunikation der EZB oder der betreffenden NZB reagieren, in denen sie zur Bestätigung der Exaktheit der statistischen Informationen oder zur Beantwortung von Fragen zu ihrer Exaktheit aufgefordert werden, um den Mindeststandard für die Exaktheit von statistischen Informationen gemäß Anhang IV.2 der Verordnung einzuhalten.

Berichtspflichtige haben zeitnah und spätestens bis 7.45 Uhr (MEZ) auf entsprechende Rückfragen zu antworten, die sie vor diesem Zeitpunkt an einem TARGET2-Geschäftstag von der EZB oder betreffenden NZB erhalten. Rückfragen, die nach 8.00 Uhr bei dem Berichtspflichtigen eingehen und in denen keine gesonderte Rückmeldefrist angegeben ist sind von dem Berichtspflichtigen bis 15.00 Uhr (MEZ) an demselben Tag zu beantworten.

---

<sup>7</sup> Bei der MEZ wird die Umstellung auf die Mitteleuropäische Sommerzeit berücksichtigt.

## 2.2.2 Datenübertragung

Die vier Datensätze sind separat in vier verschiedenen Dateien zu übertragen. Die Datensätze sowie die für die einzelnen Segmente zu meldenden Variablen sind in diesem Dokument näher spezifiziert.

Bei Berichtspflichtigen, die zur Übertragung von Daten direkt an NZBen verpflichtet sind, werden die Berichtsverfahren von den betreffenden NZBen festgelegt und implementiert, wie dies in der Verordnung vorgesehen ist. Im Regelfall ist für jeden TARGET2-Handelstag pro Marktsegment eine Meldung einzureichen, welche die meldepflichtigen Transaktionen des Meldetermins sowie etwaige Korrekturen oder fehlende Transaktionen vorheriger Tage beinhaltet. Gleichwohl ist es für alle Institute, die ihre Meldungen bei der Deutschen Bundesbank einreichen, möglich, Korrekturen sowie fehlende Transaktionen in einer separaten Meldung (unabhängig von der regulären Meldung) einzureichen.

Die in Anhang IV.1 der Verordnung aufgeführten Mindeststandards für die Übermittlung schreiben u. a. vor, dass die Meldung pünktlich und innerhalb der o.g. Frist an die Deutsche Bundesbank erfolgen muss. Bewährte Methoden von Berichtspflichtigen, die dazu beitragen, potenzielle Übermittlungsprobleme zu minimieren, sind u.a.:

- Geeignete interne Testverfahren und Prüfungen für die Wartung von IT-Systemen, die sich direkt oder indirekt auf den MMSR-Datenversand auswirken (z. B. Handelssysteme, Meldesysteme);
- Vorverlegung der Übertragung der MMSR-Dateien (z. B. Meldung am Vorabend oder Übertragung Freitagnacht oder Samstagmorgen anstelle von Montagmorgen);
- Personalverfügbarkeit früh morgens an TARGET2-Geschäftstagen, um potenzielle technische Probleme zu lösen und/oder die MMSR-Dateien manuell hochzuladen;
- Implementierung eines automatisierten Wiederholungsprozesses (Retry-Prozess, entsprechend bewährten IT-Methoden) für den Fall, dass die ursprüngliche Einreichung fehlschlägt;
- ausreichende Überprüfung in einer Testumgebung, regelmäßiges Üben der manuellen Einreichung von Daten sowie die Einrichtung und Verwendung eines Notfallweges im Falle von Übertragungsproblemen.

Die in der Verordnung (Anhänge IV.2 und IV.4) aufgeführten Mindestanforderungen erfordern die Bereitstellung von Informationen über Entwicklungen in den gemeldeten Daten und deren Korrektur, wenn korrekturbedürftige Fehler festgestellt werden. In diesem Zusammenhang sind Berichtspflichtige angehalten, die übertragenen Transaktionsdaten und Dateien für einen Zeitraum von mindestens fünf Jahren aufzubewahren und zu speichern.

## 2.2.3 Unique Transaction Identifier

Sofern verfügbar, ist die Meldung eines Unique Transaction Identifier (UTI; eindeutige Transaktionskennung) erforderlich.<sup>8</sup> Dieser sollte grundsätzlich für Transaktionen in den Segmenten besicherter Geldmarkt, OIS und Devisenswapgeschäfte verfügbar sein.

---

<sup>8</sup> Das UTI-Schema ist in ISO 23897:2020 definiert.

Berichtspflichtige sind zur Meldung der UTI verpflichtet, wenn diese zum Zeitpunkt der Meldungseinreichung verfügbar ist. Die UTI gilt auch dann als verfügbar, wenn für ihre Meldung operative und technische Anpassungen seitens der Berichtspflichtigen erforderlich sind. Ergibt sich nach der initialen Meldung eine Änderung der UTI (z. B. wenn eine vorläufige UTI durch die finale ersetzt wird), ist ein Amendment für die ursprünglich gemeldete UTI einzureichen. Falls die UTI erst nach Einreichung der erstmaligen Meldung für Geldmarktstatistikzwecke verfügbar ist, besteht keine Verpflichtung, allein für die Zwecke der Meldung der UTI ein Amendment einzureichen. Nach Möglichkeit sollte die UTI dennoch mittels einem Amendment nachgereicht werden, sobald sie verfügbar ist, auch wenn dies erst nach der üblichen Korrekturfrist von zehn Tagen (siehe Kapitel 2.2.4) der Fall ist.

Wird bei einer Neuverhandlung eine neue UTI generiert, so ist diese zu melden. Sofern keine neue UTI vergeben wird, ist die neu verhandelte Transaktion mit der alten UTI zu melden. Bei Korrekturen sollte die UTI nicht verändert werden. Für Open Repos und ähnliche Transaktionen, die täglich als neue Transaktionen zu melden sind (siehe Kapitel 3.2), ist für die anfängliche Meldung und die folgenden Rollover die gleiche UTI zu verwenden, es sei denn, die Gegenparteien haben (z. B. im Rahmen einer Zinsanpassung) eine neue UTI vereinbart. In diesem Fall ist die neue UTI für die folgenden Rollover zu melden. Bei Compression Trades darf die UTI des ursprünglich gemeldeten Geschäfts von dem Berichtspflichtigen nicht korrigiert werden, auch wenn die resultierende Transaktion über eine andere UTI verfügt.

Es ist stets die vollständige und ungekürzte UTI zu melden. Da bei Devisenswapgeschäften grundsätzlich nur eine UTI vorhanden ist, ist diese somit für die Geldmarktstatistik zu melden. Sollten es jedoch für die beiden Seiten des Geschäfts unterschiedliche UTIs geben, ist die UTI der langen Seite (Far Leg) zu melden.

Die Meldung der UTI – sofern bei Meldungseinreichung durch die Berichtspflichtigen verfügbar – ist für Transaktionen ab dem Referenztag 31. März 2022 verpflichtend.

## **2.2.4 Korrekturen**

Die vom Berichtspflichtigen gemeldeten Transaktionen müssen die vereinbarten Geschäftskonditionen korrekt widerspiegeln. Sollte dies nicht der Fall sein, ist eine Korrektur der zuvor eingereichten Meldesätze einzureichen. Dabei muss die Korrektur denselben Proprietary Transaction Identifier (PTI; interne Transaktionskennung) aufweisen wie die ursprünglich gemeldete Transaktion.

Korrekturen müssen innerhalb von zehn TARGET2-Handelstagen nach der erstmaligen Meldung der zu korrigierenden Transaktionen (nachfolgend „10-tägige Korrekturfrist“) erfolgen. Ausgenommen sind Korrekturen, die der Bereitstellung der UTI dienen, wenn diese zum Zeitpunkt der ursprünglichen Meldung noch nicht verfügbar war. Reicht der Berichtspflichtige Korrekturen nach Ablauf dieser 10-tägigen Korrekturfrist ein, muss er die Bundesbank (i) über die Nichteinhaltung dieser Frist informieren und (ii) über das/die aufgetretene/n Problem/Probleme sowie über den voraussichtlichen Zeitpunkt der Korrekturmeldung in Kenntnis setzen.

Unbeschadet der generellen Verpflichtung zur Einreichung von Korrekturen innerhalb der 10-tägigen Korrekturfrist ist im Fall von während oder nach der 10-tägigen Korrekturfrist festgestellten strukturellen

Problemen<sup>9</sup> der Mindestzeitraum, für den Korrekturen einzureichen sind, der Zeitraum ab dem Beginn des vorangegangenen Kalenderjahres, gezählt ab dem Zeitpunkt der Mitteilung des Fehlers an den Berichtspflichtigen. Wird beispielsweise ein Fehler am 30. September 2021 mitgeteilt, müssen Korrekturen mindestens für den Zeitraum ab dem 1. Januar 2020 eingereicht werden. Dieser Zeitraum gilt unabhängig von der Lösung des Problems im System des Berichtspflichtigen. Im vorstehenden Beispiel müssen die Korrekturen mindestens für den Zeitraum ab dem 1. Januar 2020 eingereicht werden, unabhängig davon, ob das Problem am 2. Dezember 2021 oder 3. März 2022 gelöst wird. Ungeachtet des Mindestzeitraums, für den Korrekturen erfolgen müssen, werden die Berichtspflichtigen ermutigt, Korrekturen für den gesamten Zeitraum ab dem ersten Tag der Meldungseinreichung zu melden.

Für Berichtspflichtige, die nach dem 1. Januar 2021 zur Meldung der Geldmarktstatistik verpflichtet wurden (im Folgenden als „neue Berichtspflichtige“ bezeichnet), gilt die oben genannte Regelung nicht innerhalb der ersten drei Meldejahre.<sup>10</sup> Neue Berichtspflichtige müssen bis zum Ende des dritten Kalenderjahres ihrer Meldung Korrekturen rückwirkend bis zum Tag ihrer ersten Meldungseinreichung (erster Tag der Übermittlung von Geldmarktstatistikdaten) vornehmen. Zum Beispiel muss ein neuer Berichtspflichtiger, der zum 1. Juli 2024 meldepflichtig geworden ist, Korrekturen vom 1. Juli 2024 bis 31. Dezember 2026 einreichen. Im Anschluss an das Ende des dritten Kalenderjahres gilt der grundsätzliche Mindestzeitraum für Korrekturen (ab dem Beginn des vorangegangenen Kalenderjahres) auch für neue Berichtspflichtige.

Korrekturen können grundsätzlich in die reguläre Meldung des darauffolgenden Tages integriert, aber auch in einer separaten (taggleichen) Meldungsdatei eingereicht werden. Korrekturen sind wie folgt zu klassifizieren:

- Amendments („AMND“) sind Korrekturen für zuvor übertragene Meldesätze aufgrund von fehlerhaften Werten in den Variablen der Transaktionsmeldesätze, die von dem Berichtspflichtigen ohne den Hinweis durch das Eurosystem festgestellt werden (z. B. falls der Berichtspflichtige feststellt, dass eine der ursprünglich gemeldeten Variablen falsch war); Amendments sind außerdem Korrekturen für zuvor übertragene Meldesätze, die sich aus Neuverhandlungen mit rückwirkender Gültigkeit, Änderungen der UTI nach der initialen Meldung oder aufgrund einer verspäteten Verfügbarkeit der UTI ergeben, auch wenn die rückwirkenden Änderungen mehr als zehn TARGET2-Handelstage in der Vergangenheit liegen;
- Corrections („CORR“) sind Fehler im Format und/oder Fehler bei den Werten in den Variablen der Transaktionsmeldesätze, die Berichtspflichtige aufgrund von Hinweisen durch das Eurosystem korrigieren und erneut übermitteln (z. B. falls das anfänglich zur Verfügung gestellte Datumsformat falsch war oder ein Pflichtfeld anfänglich nicht ausgefüllt wurde);
- Cancellations („CANC“) sind übermittelte Meldesätze, die gelöscht werden müssen. Eine Löschung kann erforderlich sein, wenn eine Transaktion doppelt gemeldet wurde, nicht zur Abwicklung kommt oder laut der Verordnung nicht unter die Meldepflicht fällt.

---

<sup>9</sup> Zu den strukturellen Problemen zählen auch Fälle, in denen festgestellt wird, dass ein Berichtspflichtiger es versäumt hat, einen vollständigen Datensatz einzureichen.

<sup>10</sup> Die Regelung für neue Berichtspflichtige gilt nur, sofern der neue Berichtspflichtige nicht aus Geschäftsvorfällen (wie z. B. Fusionen) aktuell Berichtspflichtiger resultiert. Hier gilt der generelle Mindestzeitraum für Korrekturen (ab dem Beginn des vorangegangenen Kalenderjahres).

Bei der Meldung von Amendments oder Corrections von bereits gemeldeten Transaktionen sind keine Cancellations zu melden.

Folgende Variablen sind im Fall von Korrekturen anzugeben:

- REPORTED TRANSACTION STATUS (Transaktionsstatus)<sup>11</sup>: Diese Variable ist stets anzugeben;
- PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung; PTI): Diese Variable ist stets anzugeben.

Ferner müssen bei Corrections und Amendments alle Variablen angegeben werden, auch wenn sie unverändert geblieben sind. Dies gilt auch für Löschungen. Bei Löschungen werden jedoch für diese Variablen die meisten Plausibilitätsprüfungen nicht durchgeführt. Eine Transaktion wird gelöscht und als inaktiv markiert, wenn sie den Data Quality Check DQX104 des jeweiligen Marktsegments erfolgreich durchläuft.

## 2.2.5 Neuverhandlungen

Neuverhandlungen sind alle Fälle, in denen sich die Parteien einer Finanztransaktion nach der ursprünglichen Vereinbarung damit einverstanden erklären, die ursprünglich vereinbarten finanziellen Bedingungen für die ursprüngliche Transaktion zu ändern. Diese Änderung kann gegen Zahlung einer Gebühr oder kostenlos erfolgen.

Werden die Konditionen von Transaktionen nach dem ursprünglichen Geschäft oder infolge einer Vereinbarung zwischen den Parteien (zum Beispiel Änderung des Zinssatzes oder der Laufzeit) neu verhandelt, erfolgt eine Meldung dieser aus der Neuverhandlung resultierenden Transaktion als neue Transaktion mit den neuen Konditionen und einer neuen PTI. Bei Neuverhandlungen ist keine Cancellation der ursprünglichen Transaktion zu melden. Die neu verhandelte Transaktion sollte nicht mit der Variablen RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Zugehörige interne Transaktionskennung) gemeldet werden und unter der Variablen NOVATION STATUS (Novationsstatus) sollte „NONO“ gemeldet werden (sofern es sich bei der Neuverhandlung nicht zusätzlich um eine Novation handelt). Neuverhandlungen bereits gemeldeter Transaktionen, bei denen die neu vereinbarten Konditionen rückwirkend angewendet werden, sind als Amendments der bereits gemeldeten Geschäfte zu melden, auch wenn die rückwirkenden Änderungen sich nach der üblichen 10-tägigen Korrekturfrist ergeben.

## 2.2.6 Life-Cycle-Events

**Life-Cycle-Events** sind Ereignisse, die nach Abschluss des Geschäfts eintreten und die gemäß der Konditionen der Transaktionen oder auf Basis des für die Transaktionen geltenden Rahmenvertrags zulässig sind oder einer der oder beiden Parteien auferlegt werden und jedoch keine Neuverhandlung beinhalten.

Sofern keine Sonderregelung vorliegt, sind Life-Cycle-Events nicht meldepflichtig.

---

<sup>11</sup> Kapitel 5 enthält eine weitere Erläuterung der Variablen REPORTED TRANSACTION STATUS (Transaktionsstatus) und PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung; PTI).

Beispiele für Life-Cycle-Events sind Veränderungen des Marktwertes von (verliehenen) Sicherheiten, Margin Calls, ein Austausch von Sicherheiten, Kuponzahlungen, die Ausübung von Optionen mit Ausnahme von vorzeitigen Rückzahlungen, Rückkäufe von ausgegebenen Wertpapieren oder die Aufstockung (Erhöhung des Nennbetrags) von bestehenden Emissionen, Compression Trades und Novations von Compression Trades, durch Geschäftsereignisse (wie z. B. Fusionen) verursachte Änderungen der Gegenpartei, die Aufnahme von und/oder der Wechsel zu vorher festgelegten Fallback-Referenzzinssätzen sowie gesetzlich oder durch Clearingstellen/CCPs (Central Clearing Counterparties) auferlegte Änderungen des vorgeschriebenen Referenzzinssatzes. Die Meldung von Novationen ist in Kapitel 2.2.7 näher beschrieben.

Die Ausübung von vorzeitigen Kündigungsmöglichkeiten und die Beendigung von Bis-auf-Weiteres-Geschäften sind wie folgt zu behandeln:

- Fixed-Term Repos mit vorzeitiger Kündigungsmöglichkeit: Life-Cycle-Events sind nicht meldepflichtig. Jedoch führt die Ausübung einer vorzeitigen Kündigungsmöglichkeit zur Beendigung der täglich rollierenden Meldung (siehe Kapitel 3.2).
- Bis-auf-Weiteres-Geschäfte: Auch hier sind Life-Cycle-Events nicht meldepflichtig, jedoch führt die Kündigung zur Beendigung ihrer täglichen Meldung (siehe Kapitel 3.2).

Bei Transaktionen, die täglich zu melden sind (wie z. B. Transaktionen ohne feste Laufzeit oder Evergreens) müssen die täglichen Meldesätze die ursprünglich gemeldeten Informationen widerspiegeln, es sei denn, wesentliche Konditionen wie der Zinssatz oder das Transaktionsvolumen werden verändert. In diesem Fall sind die neuen Konditionen analog zu anderen Neuverhandlungen zu melden (siehe Kapitel 3.2). Teilrückzahlungen werden somit im Rahmen des jeweiligen täglichen Meldesatzes der Bis-auf-Weiteres-Transaktion als Teil der Überarbeitung aller gemeldeten Felder abgebildet.<sup>12</sup>

## 2.2.7 Novationen

Novationen sollten grundsätzlich in derselben Weise gemeldet werden wie Neuverhandlungen. Falls eine Novation stattfindet, muss diese als neue Transaktion mit den neu verhandelten Geschäftskonditionen gemeldet werden und die Übertragung der Verpflichtungen widerspiegeln, die sich aus dem Novationsprozess ergeben.<sup>13</sup>

Die Berichtspflichtigen müssen die folgenden Regeln einhalten, die der Vermeidung von Doppelmeldungen dienen:

- a) Novationen, die am selben Tag wie die anfängliche Transaktion erfolgen:

Der Berichtspflichtige meldet lediglich die Novation als neue Transaktion mit der neuen Gegenpartei (d. h. entsprechend der allgemeinen Regel). Der Berichtspflichtige meldet für diese Novationen nicht die

---

<sup>12</sup> Sofern keine Neuverhandlung vorliegt, sollten jedoch Sicherheitsattribute wie der COLLATERAL NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Sicherheit(en)), der COLLATERAL HAIRCUT (Sicherheitsabschlag), der COLLATERAL TYPE (Art der Sicherheit) sowie der COLLATERAL ISSUER SECTOR (Sektor des Emittenten der Sicherheit) nicht überarbeitet werden, wenn die Änderungen sich u. a. aus Margin Calls, dem Austausch von Sicherheiten oder Marktwertveränderungen der Sicherheit ergeben (siehe Kapitel 3.2).

<sup>13</sup> Änderungen der Gegenpartei aufgrund von Geschäftsereignissen (wie z. B. Fusionen) sind nicht als Novationen zu melden. Bei Repos ohne feste Laufzeit und ähnlichen Transaktionen, die durchgehend täglich als neue Transaktionen zu melden sind (siehe Kapitel 3.2), ist es im Fall einer Änderung der Gegenpartei aufgrund von Geschäftsereignissen nicht erforderlich, den NOVATION STATUS (Novationsstatus) und die RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Zugehörige interne Transaktionskennung) zu melden, und es ist ausreichend, beim Eintreten der Änderung lediglich die neue LEI (Legal Entity Identifier; Rechtsträgerkennung) der Gegenpartei mit dem entsprechenden Rollover zu melden.

Variablen NOVATION STATUS (Novationsstatus) und RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Zugehörige interne Transaktionskennung). Alternativ kann der NOVATION STATUS mit dem Flag „NONO“ („Keine Novation“) und ohne RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION gemeldet werden.

b) Novationen, die (mindestens einen Tag) nach der anfänglichen Transaktion erfolgen:

Es gilt die allgemeine Regel – d. h. in diesem Fall ist die Novation als neue Transaktion und der NOVATION STATUS ist mit dem Flag „NOVA“ („Novation“) zu versehen. Darüber hinaus ist die PTI der zugehörigen ursprünglichen Transaktion in dem Feld RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION zu melden, falls die ursprüngliche Transaktion zuvor gemeldet wurde.

Darüber hinaus gelten die folgenden Regeln:

- Die verbleibende Gegenpartei meldet eine neue Transaktion, die den neu eingestiegenen Kontrahenten als Gegenpartei ausweist. In Bezug auf die Meldung des NOVATION STATUS und der PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION gelten die vorstehend aufgeführten Regeln.
- Die neu eingestiegene Gegenpartei meldet eine neue Transaktion unter Angabe der verbleibenden Gegenpartei sowie der Bedingungen des ursprünglichen Geschäfts. Das Feld NOVATION STATUS ist mit dem Flag Kennzeichen „NOVA“ („Novation“) für die Novation zu melden. Eine RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION ist jedoch **nicht** anzugeben.
- Die aussteigende Gegenpartei hat keine Meldung in Form einer Correction oder Cancellation abzugeben.

Es besteht die Möglichkeit, dass die Gegenparteien einer Novation den Start-/Valuta-/Abwicklungstag des ursprünglichen Geschäfts übernehmen. In diesem Fall liegt der Start-/Valuta-/ Abwicklungstag vor dem Handelstag der Novation und muss dementsprechend gemeldet werden.

Falls eine Novation dazu führt, dass ein Geschäft nicht mehr berichtspflichtig ist (d. h. die neu eingestiegene Gegenpartei stellt keine in der MMSR meldepflichtige Gegenpartei dar), muss dieses Ereignis nicht gemeldet werden und es ist keine Übermittlung einer Cancellation für das ursprüngliche Geschäft erforderlich.

Die Pflicht zur Meldung des Novation-Flags gilt sowohl für Transaktionen mit fester Laufzeit als auch für Bis-auf-Weiteres-Transaktionen oder Evergreens. Bei BAW-Geschäften oder Evergreens ist die PTI des letzten vor der Novation gemeldeten Rollover bei dem ersten Rollover nach der Novation als RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION anzugeben. Außerdem sind die Felder RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION und NOVATION STATUS nur beim ersten Rollover nach der Novation zu melden. Für die folgenden Rollover werden diese beiden Felder nicht gemeldet, es sei denn, es kommt zu einer weiteren Novation.

## **2.3 Konzeptionelle Struktur der Meldung zur Geldmarktstatistik**

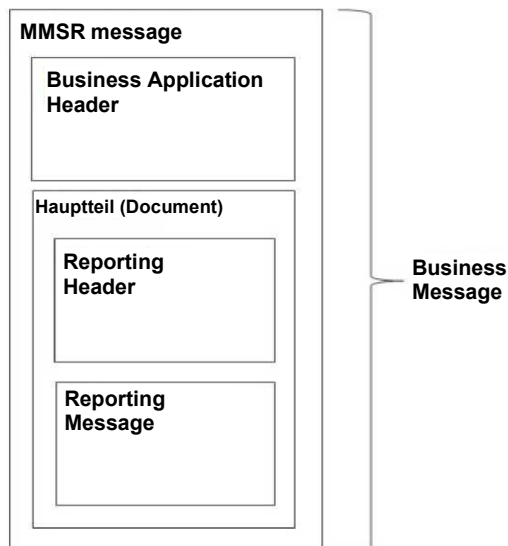
In den nachstehenden Abschnitten werden die konzeptionelle Struktur der Meldungen zur Geldmarktstatistik (MMSR message) sowie die konzeptionellen Definitionen der Meldefelder erläutert.

Jede Datei, die zur Geldmarktstatistik (MMSR) eingereicht wird, besteht aus einer MMSR message (d. h. Business Message), die sich auf eines der vier verschiedenen Marktsegmente bezieht.

Eine Business Message für ein bestimmtes Marktsegment besteht aus zwei Teilen:

- (a) einem Business Application Header (BAH), der zur Identifikation der Meldung dient und Zustellinformationen enthält, und
- (b) einem Hauptteil (Document), der aus zwei Teilen besteht: dem Reporting Header und der Reporting Message für das betroffene Marktsegment.
  - (i) Der Reporting Header dient der Erkennung des Berichtspflichtigen, der Referenzperiode sowie des Inhalts der Meldung.
  - (ii) Die Reporting Message enthält alle relevanten Informationen zu den Transaktionen im jeweiligen Marktsegment gemäß den ISO 20022-Schemadateien auth.012.001.02, auth.013.001.02, auth.014.001.02, bzw. auth.015.001.02.

Die konzeptionelle Struktur der Meldung zur Geldmarktstatistik wird im Folgenden grafisch dargestellt:



### 2.3.1 Konzeptionelle Struktur des Business Application Header

Die Variablen des Business Application Headers (BAH) und ihre Erläuterungen sind in der folgenden Tabelle aufgeführt:

Name der Variablen	Beschreibung
Business Message Identifier (Meldungs-ID)	Der Business Message Identifier setzt sich aus einer Kennung für den Berichtspflichtigen und einer einzigartigen, sechsstelligen Zahl für die jeweiligen Dateneinreicher gesendeten Dateien zusammen, um so jede einzelne Datei im Rahmen der bilateralen Kommunikation individuell zuordnen zu können.
Sender (Absender)	Diese Variable enthält den LEI (Legal Entity Identifier) des Einreichers. Diese Variable wird im BAH der MMSR message als „From“ bezeichnet.

Empfänger (Receiver)	Diese Variable enthält den LEI (Legal Entity Identifier) der Deutschen Bundesbank Diese Variable ist als „To“ im BAH der MMSR message bezeichnet.
Business Service	Diese Variable kennzeichnet den Service, an den der Empfänger die gemeldeten Daten zustellen soll. Es gibt zwei gültige Werte: ECB_MMSR_PROD und ECB_MMSR_TEST. Für die regelmäßige Meldung soll „ECB_MMSR_PROD“ verwendet werden. „ECB_MMSR_TEST“ soll ausschließlich verwendet werden, um den Übertragungsweg zu testen. Meldungen mit dem Status „ECB MMSR TEST“ werden nicht in der Produktionsumgebung weiterverarbeitet.
Market Segment Identifier (Marktsegment)	Mit dieser Variable wird spezifiziert, in welchem der folgenden Marktsegmente die Transaktion getätigt wurde: besicherter Geldmarkt, unbesicherter Geldmarkt, Devisenswapgeschäfte oder OIS. Diese Variable wird im BAH der MMSR message als „Message Definition Identifier“ bezeichnet.
Creation Date (Erstellungsdatum)	Diese Variable enthält das Erstellungsdatum der Meldedatei.

### 2.3.2 Konzeptionelle Struktur des Reporting Header

Die Variablen des Reporting Header und entsprechende Beschreibungen sind in der folgenden Tabelle aufgeführt:

Name der Variablen	Beschreibung
Reporting Agent (Berichtspflichtiger)	Diese Variable enthält die LEI des berichtspflichtigen Instituts.
Reference Period (Referenzperiode)	Diese Variable enthält den genauen Berichtszeitraum (Start- und Enddatum) der Transaktionen, die in der Datei enthalten sind (Trade Date (Handelstag) der neuen Transaktionen sowie eingereichten Amendments, Corrections oder Cancellations).

### 2.3.3 Felddefinitionen für den Header in allen Segmenten

Die Geldmarktstatistik-Felddefinitionen für den BAH sind in der folgenden Tabelle aufgeführt:

Variable	Name der Variablen	Art	Beispiel
H10	Business Message Identifier (Meldungs-ID)	Zeichenkette	IREF012345
H20	Sender (Absender)	Zeichenkette LEI [ISO 17442]	QS3ZEAHRBZY9228Z0111

H30	Receiver (Empfänger)	Zeichenkette LEI [ISO 17442]	„529900SEOICVR2VM6Y05“ (LEI der Deutschen Bundesbank)
H40	Business Service	Zeichenkette. Länge: 13 ECB_MMSR_PROD und ECB_MMSR_TEST	„ECB_MMSR_PROD“ oder „ECB_MMSR_TEST“.
H50	Market Segment Identifizier (Marktsegment)	Zeichenkette. Länge: 15 CL_MARKET_ SEGMENT (siehe Anhang I)	auth.012.001.02
H60	Creation Date (Erstellungsdatum)	Tag und Uhrzeit wie in ISO 20022 angegeben, (Angleichung an ISO 8601) YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ	2016-07-01T19:30:00Z

Die Felddefinitionen für den Reporting Header der Geldmarktstatistik sind in der folgenden Tabelle aufgeführt:

Variable	Name der Variablen	Art	Beispiel
H70	Reporting Agent (Berichtspflichtiger)	Zeichenkette. Maximale Länge: 20 [ISO17442]	„QS3ZEAHRBZY9228Z0111“ bezieht sich auf die LEI der Commerzbank International S.A.
H80	Reference Period (Referenzperiode)	Tag und Uhrzeit [ISO 8601] YYYY-MM-DDThh:mm:ss+/- hh:mm Die Angabe der Zeitzone („+/- hh:mm“) muss stets enthalten sein.	2016-07-01T18:00:00+01:00 2016-07-02T18:00:00+01:00

### 2.3.4 Konzeptionelle Definitionen in allen Reporting Messages der Geldmarktstatistik

Sollte ein Berichtspflichtiger in einem bestimmten Marktsegment keine Transaktionen getätigt haben, beginnt die Reporting Message für das entsprechende Geldmarktsegment mit der in der nachstehenden Tabelle erläuterten Variablen. Nicht alle Variablen und Elemente, die im XML-Schema nach ISO 20022 für die Geldmarktstatistik enthalten sind, finden derzeit in der Geldmarktstatistik Anwendung. Insbesondere der Code „NORA“, der Teil der Codeliste der Variable Data Set Action ist, ist von den Berichtspflichtigen nicht zu verwenden und daher nicht in der nachfolgenden Tabelle und in Anhang I enthalten.

Name der Variablen	Beschreibung
Data Set Action (Datensatzaktion)	<p>Diese Variable spezifiziert den Inhalt der Meldung und löst die entsprechende Bearbeitung in der empfangenden Business-Anwendung aus.</p> <p>„NOTX“ – Der Berichtspflichtige hat im betreffenden Marktsegment keine getätigten Transaktionen zu melden.</p> <p><i>Dieses Feld ist optional. Werden Transaktionen gemeldet, ist dieses Feld in der XML-Datei nicht enthalten.</i></p>

### 2.3.5 Felddefinitionen für Daten aller Marktsegmente

Variable	Name der Variablen	Art	Beispiel
D10	Data Set Action (Datensatzaktion)	Zeichenkette CL_DATASETACTION (siehe Anhang I)	NOTX

Grundsätzlich ist ein Punkt als Dezimaltrennzeichen zu verwenden. Ferner dürfen die ausgewiesenen Werte kein Komma als Tausendertrennzeichen enthalten.

## 3. Konzeptionelle und Felddefinitionen für das besicherte Marktsegment

Berichtspflichtige müssen Fixed-Term- und Bis-auf-Weiteres-Repos (Open Repos; BAW-Repos) sowie Sell/Buy-Back-Geschäfte (Kauf-/Rückkaufgeschäfte) und bestimmte Wertpapierleihen, die wirtschaftlich äquivalent zu Repogeschäften sind, an die Deutsche Bundesbank melden.

Die Meldepflicht beschränkt sich auf Transaktionen, die auf Euro lauten (mit einem Nennwert von mindestens 500.000 EUR) und eine Laufzeit von bis zu und einschließlich einem Jahr (definiert als Transaktionen mit einer Laufzeit von nicht mehr als 397 Tagen nach dem Abwicklungstag) aufweisen, die von dem Berichtspflichtigen mit finanziellen Kapitalgesellschaften (mit Ausnahme von Zentralbanken, wenn die Transaktion mit geldpolitischen Operation des Eurosystems bzw. ständigen Fazilitäten im Zusammenhang steht), dem Staat sowie mit nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, die nach dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk als „Großkunden“ klassifiziert sind, durchgeführt werden.

Lediglich das Opening Leg (Eröffnung) der Transaktionen sollte gemeldet werden (d. h. falls der Berichtspflichtige der Empfänger der Sicherheit ist, meldet er das Kaufgeschäft (Purchase Leg) der Transaktion, aber nicht die Rückkaufseite (Repurchase Leg)).

### 3.1 Tri-Party-General-Collateral-Geschäfte

Tri-Party-General-Collateral-Geschäfte sind Transaktionen, bei denen die Gegenparteien die spezifischen als Sicherheiten zu verwendenden Wertpapiere weder auswählen noch darüber verhandeln. Stattdessen wird eine breite Klasse an Sicherheiten, die vorher festgelegte Kriterien erfüllt, als zulässig definiert, woraufhin ein Drittdienstleister (Tri-Party-Agent) während der Laufzeit des Geschäfts die Auswahl und Verwaltung der einzelnen Wertpapiere übernimmt.

Bei Tri-Party-General-Collateral-Geschäften ist nur die Information über die Klasse der Sicherheiten (auch „Pool“ oder „Basket“) zu melden, die für das Geschäft verwendet werden darf. Es ist keine Information zu den tatsächlichen Wertpapieren, die vom Tri-Party-Agent ausgewählt werden, erforderlich. Es ist zwischen zwei Fällen zu unterscheiden:

- Wenn der Pool oder Basket der zulässigen Wertpapiere über eine ISIN (auch als synthetische oder Pseudo-ISIN des Basket bekannt) identifiziert werden **kann**, ist diese ISIN im Feld COLLATERAL ISIN (ISIN der Sicherheit(en)) zu melden. Dies betrifft bspw. Sicherheitenpools der EUREX/GC Pooling und LCH/GC+.
- Wenn der Pool oder Basket der zulässigen Wertpapiere **nicht** über eine ISIN identifiziert werden **kann**, ist die Information zur Klasse der Sicherheiten, die für das Geschäft verwendet werden darf, wie folgt zu melden<sup>14</sup>:
  - o Im Feld COLLATERAL TYPE (Art der Sicherheit(en)) ist der Classification of Financial Instruments Code (CFI-Code) derjenigen Sicherheitenklasse zu melden, die die für das Geschäft zulässige Klasse an Sicherheiten am besten beschreibt. Bestehen die zulässigen Wertpapiere z. B. hauptsächlich aus nicht näher spezifizierten Anleihen, kann der Code „DBXXXX“ gemeldet werden.
  - o Im Feld COLLATERAL ISSUER SECTOR (Sektor des Emittenten der Sicherheit(en)) ist der institutionelle Sektor zu melden, der den größten Anteil an den Emittenten der zulässigen Sicherheiten ausmacht. Befinden sich im Basket der zulässigen Wertpapiere z. B. hauptsächlich als „Investment Grade“ eingestufte Staatsanleihen der Eurozone, ist der Code „S13“ zu melden.
  - o Im Feld COLLATERAL POOL STATUS (Sicherheitenpool) ist der Code „POOL“ zu melden, um deutlich zu machen, dass die in den Feldern COLLATERAL TYPE (Art der Sicherheit(en)) und COLLATERAL ISSUER SECTOR (Sektor des Emittenten der Sicherheit(en)) angegebenen Informationen sich auf die Pool-Ebene und nicht auf einzelne Sicherheiten beziehen.

In jedem Fall ist die LEI des Tri-Party-Agent im Feld TRIPARTY AGENT IDENTIFICATION (Kennung des Tri-Party-Agents) anzugeben.

Die Felder COLLATERAL NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Sicherheit(en)) und HAIRCUT (Sicherheitsabschlag) sind für Tri-Party-Geschäfte nicht verpflichtend zu melden.

---

<sup>14</sup> Diese Regeln gelten auch für „Reverse Securities Loans“, wie in Kapitel 3.3 erläutert.

### 3.2 Meldung von Open Repos, kündbaren Fixed-Term Repos, Evergreen und Extendible Repos

**Open Repos**<sup>15</sup> (open-basis repurchase agreements) sind Repos ohne feste Laufzeit und mit einer Kündigungsfrist, die nicht über die konventionelle oder obligatorische Abwicklungsfrist von Sicherheiten (i. d. R. T+0, T+1 oder T+2) hinausgeht. Open Repos sind bis zur Kündigung durchgehend täglich als neue Transaktion zu melden, mit einem neuen Meldesatz pro Geschäftstag.

Wird das Open Repo erstmalig vereinbart, wird der erste Meldesatz mit der folgenden Datumsstruktur gemeldet:

- Handelstag: T
- Abwicklungstag: T + S
- Fälligkeitstag: T + S + 1

Dabei entspricht S meist 0, 1 oder 2 Geschäftstagen, abhängig von der tatsächlich vereinbarten Abwicklungsdauer des Geschäfts („S=0“ steht für eine taggleiche Abwicklung, „S=1“ für eine Abwicklung am auf den Handelstag folgenden Geschäftstag usw.).

Spätere Meldesätze werden für jeden auf den Abwicklungstag folgenden Geschäftstag mit der folgenden Datumsstruktur übermittelt, vorausgesetzt, die Transaktion läuft noch:

	1. Meldesatz	2. Meldesatz	3. Meldesatz	...
• Handelstag:	AT + 1,	AT + 2,	AT + 3	...
• Abwicklungstag:	AT + 1,	AT + 2,	AT + 3	...
• Fälligkeitstag:	AT + 2,	AT + 3,	AT + 4	...

Dabei bezieht sich AT auf den für das Geschäft vereinbarten Abwicklungstag (der als Abwicklungstag für den ersten zum Zeitpunkt der Vereinbarung des Open Repo gemeldeten Meldesatz gemeldet wurde).

Alle Meldesätze in Bezug auf das Open Repo sind mit dem Transaktionsstatus „NEWT“ und jeweils einer eigenen, neuen PTI zu melden. Dies gilt sowohl für die erste als auch für darauffolgende Meldungen. Grundsätzlich gilt für alle diese Meldesätze dieselbe UTI.

Sobald ein Open Repo gekündigt wird, endet die tägliche Meldung. Die letzte Meldung des Open Repo erfolgt mit dem Handels- und Abwicklungstag, an dem die Kündigung ausgesprochen wird, unabhängig davon, wann die Kündigung des Geschäfts tatsächlich wirksam wird<sup>16</sup>.

Spätere Meldesätze für Open Repos sollen jeweils die bei Vertragsabschluss ursprünglich vereinbarten Angaben widerspiegeln, es sei denn, wesentliche Konditionen wie der Zinssatz oder das Transaktionsvolumen werden verändert. In diesem Fall sollen die neuen Konditionen analog zu anderen Neuverhandlungen gemeldet

<sup>15</sup> Die nachstehenden Anweisungen zur Meldung von Open Repos gelten auch für die Meldung von Open Evergreens, sofern nicht etwas anderes angegeben ist.

<sup>16</sup> Die Fälligkeit von Wertpapierleihen ohne feste Laufzeit wird analog gemeldet.

werden. Sofern keine Neuverhandlung vorliegt, sollen die Attribute der Sicherheiten wie der COLLATERAL NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Sicherheit(en)), der COLLATERAL HAIRCUT (Sicherheitsabschlag), der COLLATERAL TYPE (Art der Sicherheit(en)) sowie der COLLATERAL ISSUER SECTOR (Sektor des Emittenten der Sicherheit(en)) nicht verändert werden, wenn die Änderungen sich u. a. aus Margin Calls, dem Austausch von Sicherheiten oder Marktwertveränderungen der Sicherheit(en) ergeben.

Ist ein Open Repo so konzipiert, dass die zu bestimmende Verzinsung von der Laufzeit abhängig ist (d. h. erst nach Beendigung der Transaktion zu berechnen), ist der ursprünglich vereinbarte Zinssatz, der auf das aufgenommene/verliehene Cash Anwendung findet, zu melden.

Open Repos mit einer Kündigungsfrist, die über die konventionelle oder obligatorische Abwicklungsfrist von Sicherheiten hinausgeht (sogenannte **Open Evergreens**<sup>17</sup>), müssen genauso wie standardmäßige Open Repos gemeldet werden, mit der Ausnahme, dass als Fälligkeitstag der Tag angegeben werden muss, an dem das Geschäft frühestens beendet werden kann.

**Fixed-Term Repos**, die über Nacht **kündbar** sind oder eine Kündigungsfrist von zwei Geschäftstagen aufweisen, sind in der Geldmarktstatistik analog zu Open Repos und mit vorstehend dargestellter Struktur zu melden. Dies bedeutet, dass sie bis zu ihrer Kündigung oder bis zum Ende ihrer festen Laufzeit (je nachdem, welcher Zeitpunkt früher eintritt) täglich als rollierende Transaktion mit einer Overnight-Fälligkeit zu melden sind.

**Fixed-Term Evergreens**, d. h. Transaktionen mit einem festen endgültigen Rückkaufdatum<sup>18</sup>, bei denen beide Parteien die Möglichkeit haben, die Transaktion unter Einhaltung einer Kündigungsfrist zu kündigen<sup>19</sup>, sind analog zu Open Evergreens fortlaufend täglich als neue Transaktionen (NEWT) zu melden:

- 1) Es ist ein täglicher Meldesatz mit dem Transaktionsstatus „NEWT“ und mit neuer PTI zu melden, wobei sowohl der Handels-, als auch der Abwicklungstag mit „T“ zu melden sind und ein Fälligkeitstag nicht das festgelegte Enddatum, sondern die Länge der vereinbarten Kündigungsfrist widerspiegelt. Lediglich bei der erstmaligen Meldung ist der tatsächliche Abwicklungstag des Geschäfts zu melden, sofern er vom Handelstag abweicht.
- 2) Die täglich rollierende Meldung ist fortzusetzen, bis eine der Parteien die Kündigung ausspricht. Die letzte tägliche Meldung weist als Handelstag das Datum auf, an dem die Kündigung ausgesprochen wurde.
- 3) Wird für das Geschäft zu keinem Zeitpunkt eine Kündigung ausgesprochen, so ist die rollierende Meldung so lange beizubehalten, bis der gemeldete Fälligkeitstag gemäß 1) das festgelegte Enddatum der Transaktion erreicht (siehe untenstehendes Beispiel 6).

---

<sup>17</sup> Weitere Details zu Best Practices und Standard-Konventionen zur Klassifizierung von Open Repos, Open Evergreens, Fixed-Term Evergreens und Extendible Repos werden von der International Capital Market Association (ICMA) bereitgestellt. Ein Open Repo ist definiert als ein Geschäft, das auf Verlangen von beiden Parteien kündbar ist und daher bis zur Kündigung weder ein Rückkaufdatum noch einen Rückkaufpreis besitzt. Standardmäßig beträgt die Kündigungsfrist eines Open Repo nicht mehr als die konventionelle oder obligatorische Abwicklungsfrist für Sicherheiten (i. d. R. T+0, T+1 oder T+2). Ein Open Evergreen Repo ist ein Geschäft ohne Rückkaufdatum, bei dem beide Parteien die Möglichkeit haben, das Geschäft mit einer Kündigungsfrist zu kündigen, die über die konventionelle oder obligatorische Abwicklungsfrist für Sicherheiten hinausgeht (siehe „A Guide to best practice in the European Repo Market“, ICMA, März 2021).

<sup>18</sup> Alle Rückkaufvereinbarungen mit einer Laufzeit von nicht mehr als 397 Tagen nach dem Abwicklungstag sind zu melden, und zwar unabhängig vom letztendlichen festen Fälligkeitstag des Vertrags

<sup>19</sup> Gemäß der Definition der ICMA in: „A Guide to best practice in the European Repo Market“, ICMA, März 2021).

Zur Beurteilung der Meldepflicht eines Fixed-Term Evergreens im Rahmen der Geldmarktstatistik ist die Länge der Kündigungsfrist anstelle des festgelegten Enddatum heranzuziehen. Somit sind Fixed-Term Evergreen-Transaktionen mit einer Kündigungsfrist von weniger als 397 Tagen unabhängig von ihrem festgelegten Enddatum meldepflichtig.

Einige Fixed-Term Repos mit „gleitendem“ Kauf- und Rückkaufdatum, sogenannte „**Crawling**“-Repos, sind so aufgebaut, dass sich am Ende des Geschäftstages sowohl das Kauf- als auch das Rückkaufdatum automatisch um einen Geschäftstag verschiebt, bis eine endgültige Terminfestsetzung stattfindet. Solche Transaktionen werden gemäß den Regeln für Fixed-Term Evergreens gemeldet. Demnach sind diese täglich als neue Transaktion „NEWT“ zu melden, wobei der Fälligkeitstag bei jedem gemeldeten Rollover dem ersten Tag entspricht, an dem das Fixed-Term Evergreen beendet werden kann.

**Extendible Repos**<sup>20</sup> werden als Repos mit fester Laufzeit gemeldet, wobei das vereinbarte Rückkaufdatum als Fälligkeitstag angegeben wird. Wird das Repo verlängert, wird ein neues Fixed-Term Repo gemeldet, welches die neuen Transaktionsdetails widerspiegelt. Änderungen oder Korrekturen für das bzw. die zuvor gemeldete(n) Extendible Repo(s) haben keine zu erfolgen. Repos (mit oder ohne feste Laufzeit), die nicht täglich, sondern nur an bestimmten vorab vereinbarten Tagen (z. B. an einem bestimmten Tag pro Quartal) gekündigt werden können, werden ebenfalls als Repos mit fester Laufzeit gemeldet. Dabei entspricht der Fälligkeitstag dem Tag, an dem das Geschäft frühestens beendet werden kann. Wird die Kündigungsoption nicht ausgeübt und das Repo verlängert, ist ein neues Repo mit fester Laufzeit und unter Angabe des Kündigungsdatums des dazugehörigen zuvor gemeldeten Fixed-Term Repo als Handelstag, des Fälligkeitstags des dazugehörigen zuvor gemeldeten Fixed-Term Repo als Abwicklungstag und des ersten Tags, an dem das neue Geschäft beendet werden kann, als Fälligkeitstag zu melden.

*Beispiele:*

- 1) Meldung eines **Open Repos** mit Handelstag T und Abwicklungstag T+2, das mit **Overnight-Fälligkeit** zurückgekauft (beendet/geschlossen/gekündigt) werden kann. An T+4 vereinbaren die beiden Gegenparteien, das Open Repo an T+6 zu schließen.

Tag	Handelstag	Abwicklungstag	Fälligkeitstag	PTI	Anmerkungen
T	T	T+2	T+3	„1“	
T+1	Keine Meldung			–	
T+2	Keine Meldung			–	
T+3	T+3	T+3	T+4	„2“	Rollover des Open Repos. Änderungen von Transaktionsdetails sind im

<sup>20</sup> Wie von der ICMA definiert, ist ein Extendible Repo eine Transaktion mit fester Laufzeit, in deren Rahmen eine Partei der jeweils anderen eine Option zur Stundung des Rückkaufdatums für einen vereinbarten weiteren Zeitraum gewährt. In einigen Verträgen über Extendible Repos besteht die Option darin, das Rückkaufdatum zu stunden und einen neuen Extendible Repo zu denselben Bedingungen wie denen des vorherigen zu begründen.

Tag	Handelstag	Abwicklungstag	Fälligkeitstag	PTI	Anmerkungen
					gemeldeten Rollover unter Beachtung der vorstehend dargelegten Regeln für die Meldung von Rollovers für BAW-Repogeschäfte widerzuspiegeln.
T+4	T+4	T+4	T+5	„3“	Rollover des Open Repos. Das Open Repo wird gekündigt, und das Geschäft wird an T+4 zum letzten Mal gemeldet. Nach der Kündigung werden keine weiteren Rollovers gemeldet.
T+5	Keine Meldung				
T+6	Keine Meldung			–	Beendigung des Geschäfts

- 2) Meldung eines **Open Repos** mit Handelstag T und Abwicklungstag T+2, das mit einer Kündigungsfrist von 30 Tagen zurückgekauft (beendet/geschlossen/gekündigt) werden kann, wie dem gemeldeten Fälligkeitstag zu entnehmen ist – auch als **Open Evergreen Repo** bezeichnet. An T+4 wird das Open Repo gekündigt und an T+34 (nach dem Ende der Kündigungsfrist) fällig.

Tag	Handelstag	Abwicklungstag	Fälligkeitstag	PTI	Anmerkungen
T	T	T+2	T+32	„1“	
T+1	Keine Meldung			–	
T+2	Keine Meldung			–	
T+3	T+3	T+3	T+33	„2“	Rollover des Open Repos. Änderungen von Transaktionsdetails sind im gemeldeten Rollover unter Beachtung der vorstehend dargelegten Regeln für die Meldung von Rollovers für BAW-Repogeschäfte widerzuspiegeln.
T+4	T+4	T+4	T+34	„3“	Rollover des Open Repos. Das Open Repo wird gekündigt, und das Geschäft wird an T+4 zum letzten Mal gemeldet. Nach der Kündigung werden keine weiteren Rollovers gemeldet.

Tag	Handelstag	Abwicklungstag	Fälligkeitstag	PTI	Anmerkungen
T+5 bis T+33	Keine Meldung			–	
T+34	Keine Meldung			–	Beendigung des Geschäfts

- 3) Meldung eines **Fixed-Term Evergreen Repos** mit Handelstag T und Abwicklungstag T+2, einem **festgelegten Enddatum** in 180 Tagen und einer **Kündigungsfrist für eine vorzeitige Kündigung** von 35 Tagen. An T+15 wird eine vorzeitige Kündigung ausgesprochen und an T+50 wird die Transaktion effektiv fällig (d. h. sie ist bis zu diesem Zeitpunkt ausstehend).

Tag	Handelstag	Abwicklungstag	Fälligkeitstag	PTI	Anmerkungen
T	T	T+2	T+37	„1“	Meldung eines neuen Fixed-Term Evergreen Repos. Der gemeldete Fälligkeitstag spiegelt den Kündigungszeitraum wider. Das festgelegte Enddatum ist nicht zu melden.
T+1	Keine Meldung			–	
T+2	Keine Meldung			–	
T+3	T+3	T+3	T+38	„2“	Rollover eines Fixed-Term Evergreen Repos. Änderungen von Transaktionsdetails sind im gemeldeten Rollover abzubilden.
...	...	...	...	...	Tägliche Rollovers eines Fixed-Term Evergreen Repos. Änderungen von Transaktionsdetails sind im gemeldeten Rollover unter Beachtung der vorstehend dargelegten Regeln für die Meldung von Rollovers für BAW-Repogeschäfte widerzuspiegeln. Bei jedem gemeldeten Rollover spiegelt der gemeldete Fälligkeitstag die vollständige Länge der Kündigungsfrist wider.
T+15	T+15	T+15	T+50	„14“	Rollover eines Fixed-Term Evergreen Repos. Das Geschäft wird gekündigt und an T+15 zum letzten Mal gemeldet. Nach der

Tag	Handels- tag	Abwick- lungstag	Fällig- keitstag	PTI	Anmerkungen
					Kündigung werden keine weiteren Rollovers gemeldet.
T+16 bis T+49	Keine Meldung			–	
T+50	Keine Meldung			–	Beendigung des Geschäfts

- 4) Meldung eines **Fixed-Term Evergreen Repo** mit Handelstag T und Abwicklungstag T+2, einem **festgelegten Enddatum** in 90 Tagen und einer **Kündigungsfrist** von 15 Tagen **für eine vorzeitige Kündigung**. Die vorzeitige Kündigung wird nicht ausgeübt, und das Geschäft läuft aus, wenn das festgelegte Enddatum an T+90 erreicht ist (und ist bis zu diesem Zeitpunkt ausstehend). Das Geschäft ist so lange täglich zu melden, bis der gemeldete Fälligkeitstag (einschließlich der Kündigungsfrist) des zugehörigen gemeldeten Rollover das festgelegte Enddatum erreicht.

Tag	Handels- tag	Abwick- lungstag	Fällig- keitstag	PTI	Anmerkungen
T	T	T+2	T+17	„1“	Meldung eines neuen Fixed-Term Evergreen Repos. Der gemeldete Fälligkeitstag spiegelt den Kündigungszeitraum wider. Das festgelegte Enddatum ist nicht zu melden.
T+1	Keine Meldung			–	
T+2	Keine Meldung			–	
T+3	T+3	T+3	T+18	„2“	Rollover eines Fixed-Term Evergreen Repos. Änderungen von Transaktionsdetails sind im gemeldeten Rollover abzubilden.
...	...	...	...	...	Tägliche Rollovers eines Fixed-Term Evergreen Repos. Änderungen von Transaktionsdetails sind im gemeldeten Rollover unter Beachtung der vorstehend dargelegten Regeln für die Meldung von Rollovers für BAW-Repogeschäfte widerzuspiegeln. Bei jedem gemeldeten Rollover spiegelt der gemeldete Fälligkeitstag die vollständige Länge der Kündigungsfrist wider.

Tag	Handels- tag	Abwick- lungstag	Fällig- keitstag	PTI	Anmerkungen
T+75	T+75	T+75	T+90	„74“	Rollover eines Fixed-Term Evergreen Repos. Es wird keine Kündigung ausgesprochen und die letzte Meldung erfolgt an T+75 mit Fälligkeitstag T+90. An T+75 erreicht der gemeldete Fälligkeitstag (einschließlich der Kündigungsfrist) das festgelegte Enddatum T+90. Nach T+75 werden keine weiteren Rollovers gemeldet.
T+76 bis T+89	Keine Meldung			–	
T+90	Keine Meldung			–	Beendigung des Geschäfts

- 5) Meldung eines **Extendible Repos** mit Handelstag T und Abwicklungstag T+2 mit einem **festen Rückkaufdatum** in 30 Tagen und der Option auf Verlängerung des Repo um weitere 30 Tage, vorbehaltlich einer Mitteilung an einem Geschäftstag während der ursprünglichen Laufzeit des Extendible Repos. An T+20 wird das Repo mit sofortiger Wirkung um weitere 30 Tage verlängert. Anschließend findet keine weitere Verlängerung statt.

Tag	Handels- tag	Abwick- lungstag	Fällig- keitstag	PTI	Anmerkungen
T	T	T+2	T+32	„1“	Meldung eines neuen Extendible Repos. Der gemeldete Fälligkeitstag spiegelt das feste Rückkaufdatum wider. Das Kündigungsdatum oder die Kündigungsfrist werden nicht gemeldet.
T+1 ... T+19	Keine Meldung			–	
T+20	T+20	T+20	T+50	„2“	Verlängerung eines Repo mit sofortiger Wirkung. Es wird eine neue Transaktion gemeldet, bei der der gemeldete Fälligkeitstag dem neuen festen Rückkaufdatum des neu vereinbarten (Extendible) Repo entspricht. Änderungen anderer

Tag	Handels- tag	Abwick- lungstag	Fällig- keitstag	PTI	Anmerkungen
					Transaktionsdetails werden in der gemeldeten Transaktion berücksichtigt.
T+21 ... T+49	Keine Meldung			–	
T+50	Keine Meldung			–	Beendigung des Geschäfts

### 3.3 Meldung von Wertpapierleihgeschäften, die wirtschaftlich äquivalent zu Repogeschäften sind

Wertpapierleihgeschäfte (Securities Lending and Borrowing Transactions, kurz SLBs) sind Transaktionen, die unter einem entsprechenden Securities-Lending-Mastervertrag oder vergleichbarem Rahmenwerk wie dem GMSLA geregelt sind. In der Geldmarktstatistik sind ausschließlich Wertpapierleihgeschäfte meldepflichtig, die wirtschaftlich äquivalent zu Repogeschäften sind.<sup>21,22</sup> Diese Geschäfte werden in der Regel „Reverse Stock Loans“ bzw. „Reverse Securities Loans“ genannt<sup>23</sup> und weisen die folgenden Merkmale auf:

- Die Transaktion ist - ungeachtet ihrer rechtlichen Struktur als Wertpapierleihgeschäft gegen Barsicherheiten - cash-getrieben. Die jeweils zu verleihenden Sicherheiten stehen damit nicht primär im Fokus der Gegenparteien, solange sie der für die Transaktion vereinbarten Sicherheitenklasse angehören. Die verliehenen Wertpapiere werden daher funktional als (allgemeine) „Sicherheiten“ zur Besicherung eines „Cash-Darlehens“ angesehen.
- Das Cash Collateral der Transaktion bleibt während der gesamten Laufzeit unverändert. Die vereinbarte Marge wird stattdessen durch die Änderung der Anzahl und/oder der Portfoliozusammensetzung der verliehenen Sicherheiten oder ansonsten durch den Austausch weiterer Wertpapiere, mit oder ohne Inanspruchnahme eines Tri-Party-Agent, beibehalten.

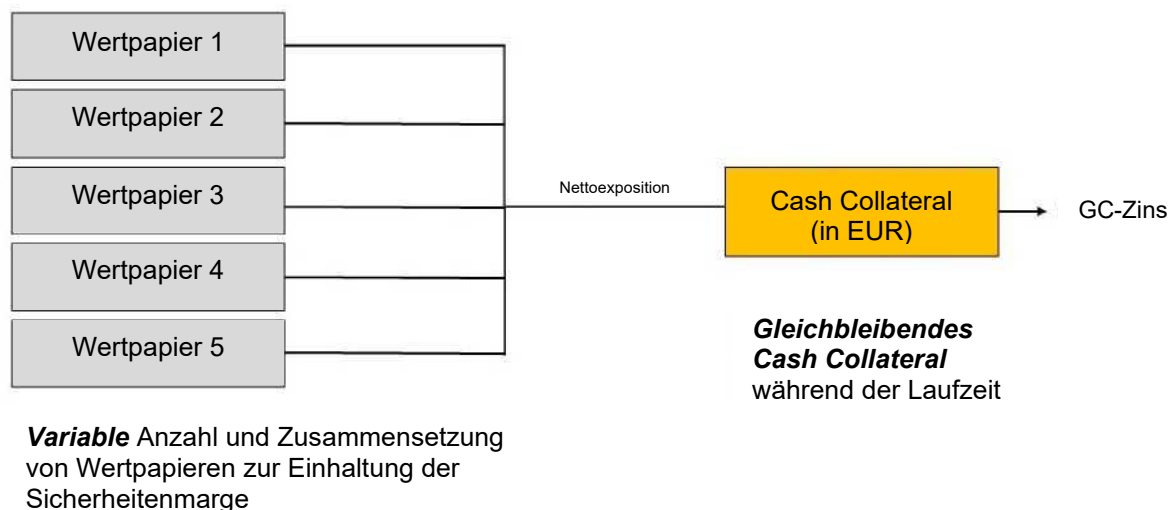
<sup>21</sup> Berichtspflichtige sollten beachten, dass die Meldepflicht von Wertpapierleihgeschäften in Version 3.6 der Richtlinien zur Geldmarktstatistik im Vergleich zu Version 3.5 stark eingeschränkt wurde. Nach Rücksprache mit den Berichtspflichtigen wurde beschlossen, dass die Beschränkung der Meldung von Wertpapierleihgeschäften gegen Cash auf Reverse Stock Loans bzw. Reverse Securities Loans eine bessere Balance zwischen Meldebelastung und benötigten Informationen schafft. Durch die neue eingeschränkte Meldepflicht von Wertpapierleihgeschäften gegen Cash wurde zudem eine Angleichung an die Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Securities Financing Transactions Regulation – SFTR) erreicht, da Reverse Securities Loans hier als grundlegend äquivalent zu Repogeschäften angesehen werden und daher nicht als Wertpapierleihgeschäfte, sondern als Repos auszuweisen sind (siehe bspw. Abschnitt 4.2.5 der ESMA-Leitlinien zur Meldung gemäß Artikel 4 und 12 der SFTR vom 29.03.2021).

<sup>22</sup> Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (ABl. L 337 vom 23.12.2015, S. 1–134).

<sup>23</sup> Gelegentlich werden diese strukturierten Geschäfte als „Transaktionen mit festem Cash-Pool“ („fixed cash pool transactions“) bezeichnet, da die zugehörige Barsicherheit nicht variabel, sondern fest ist, um – wie bei gewöhnlichen Cash-Pool-Transaktionen – die Marge einzuhalten.

- Der Geldgeber erhält im Rahmen der Transaktion einen Zinssatz. Explizite Leihgebühren für die verliehenen Sicherheiten werden wiederum üblicherweise nicht vereinbart. Dies steht im Einklang mit der cashgetriebenen Ausrichtung der Transaktion.
- Die Transaktionen werden häufig mit offener Laufzeit gehandelt.

Die folgende Grafik veranschaulicht die typische Struktur von Reverse Stock Loans bzw. Reverse Securities Loans.



Es sind nur Reverse Securities Loans meldepflichtig, bei denen das Cash Collateral auf Euro lautet. Wenn ein Reverse Securities Loan mit mehreren Fixed Collateral Cash Pools besichert ist (von denen z. B. einer auf USD und einer auf EUR lautet), ist nur der auf Euro lautende Cash Pool meldepflichtig. Die Meldepflicht ist unabhängig von der Art der Abwicklung der verliehenen Wertpapiere. Auf Euro lautende Reverse Securities Loans sind sowohl bei der Abwicklung als Delivery versus Payment (DVP) als auch bei Free of Payment (FOP) meldepflichtig.<sup>24</sup>

Im Einklang mit der wirtschaftlichen Rolle, die die Cash- und Wertpapierseite bei einem Reverse Securities Loan einnimmt, werden die betreffenden Transaktionen wie folgt gemeldet:

- Das auf Euro lautende Cash Collateral wird im Feld TRANSACTIONAL NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Transaktion) gemeldet. Änderungen im Marktwert der verliehenen Sicherheiten sollten nicht zu Änderungen in diesem Feld führen, da die Einhaltung der Sicherheitenmarge durch Anpassungen des Kreditportfolios oder durch den Austausch zusätzlicher Sicherheiten erreicht wird.
- Die verliehenen Sicherheiten werden analog zu den Sicherheiten gemeldet, die im Rahmen von General-Collateral-Geschäften durch einen Tri-Party-Agent verwaltet werden.<sup>25</sup> Es sind demnach nur Sicherheiteninformationen auf Pool-Ebene erforderlich. Dies gilt unabhängig davon, ob die Lieferung und Rückgabe von Sicherheiten zur Einhaltung der Marge von einem Tri-Party-Agent oder den beteiligten Gegenparteien selbst übernommen wird. Für die verliehenen Sicherheiten sind somit die Felder

<sup>24</sup>Bei DVP erfolgt ein unwiderruflicher, gegenseitiger und gleichzeitiger Austausch von Wertpapieren und Cash zwischen dem Verleiher und dem Entleiher. Im Falle Abwicklung FOP wird der Austausch von Cash und Wertpapieren separat und zu unterschiedlichen Zeitpunkten durchgeführt.

<sup>25</sup>Zur Meldung von Pools oder Baskets zulässiger Wertpapiere, die nicht über eine ISIN identifiziert werden können, siehe Kapitel 3.1.

COLLATERAL TYPE (Art der Sicherheit), COLLATERAL ISSUER SECTOR (Sektor des Emittenten der Sicherheit(en)) und COLLATERAL POOL STATUS (Sicherheitenpool) zu melden. Die Angabe der Felder COLLATERAL NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Sicherheit) und HAIRCUT (Sicherheitsabschlag) ist nicht verpflichtend.

- Das Feld TRANSACTION TYPE (Art der Transaktion) soll Aufschluss über die Lieferrichtung der Cash-Seite geben, d. h.

LEND: Der Berichtspflichtige liefert Cash Collateral und leiht Sicherheiten.

BORR: Der Meldepflichtige erhält Cash Collateral und verleiht Sicherheiten.

- Die Verzinsung des Cash Collateral wird im Falle eines festen Zinssatzes im Feld DEAL RATE (Zinssatz der Transaktion) bzw. im Fall eines variablen Zinssatzes in den Feldern REFERENCE RATE INDEX (Referenzzinssatz) und BASIS POINT SPREAD (Spread in Basispunkten) gemeldet.
- Bei Transaktionen mit fester Laufzeit soll als SETTLEMENT DATE (Abwicklungstag) das Datum angegeben werden, an dem das Cash Collateral abgewickelt wurde, das ggf. vom Abwicklungstag der verliehenen Sicherheiten abweichen kann.
- Bei Transaktionen mit fester Laufzeit soll als MATURITY DATE (Fälligkeitstag) das Datum angegeben werden, an dem das Cash Collateral zurückgezahlt werden muss, das ggf. vom Tag der Rückgabe der verliehenen Sicherheiten abweichen kann.

Reverse Securities Loans bzw. Reverse Stock Loans ohne feste Laufzeit sind täglich als neue Transaktion (NEWT) zu melden, und zwar analog zu den Regeln für Open Repos (siehe Kapitel 3.2).<sup>26</sup> Sollte sich eine Änderung der Variablen der Transaktion ergeben, ist diese unter Berücksichtigung der in Kapitel 3.2 genannten Regeln für die Meldung von Rollovers bei BAW-Repogeschäften in der Meldung des Rollovers wiederzugeben.

Bei Open-basis Reverse Securities Loans/Open Reverse Stock Loans mit einer Kündigungsfrist von über einem Tag ist auf rollierender Basis der Tag, an dem das Geschäft frühestens beendet werden kann, als Fälligkeitstag zu melden. Die Regeln für die Meldung von Reverse Securities Loans/Open Reverse Stock Loans bei Kündigung entsprechen den in Kapitel 3.2 erläuterten Regeln für die Meldung der Kündigung von Open Repos.

Sonstige Merkmale im Zusammenhang mit BAW-Geschäften, vorzeitige Kündigungsmöglichkeiten, Mindestkündigungsfristen, kündbare Merkmale oder Verlängerungsfristen, die in diesem Kapitel nicht ausdrücklich genannt werden, sind analog zu den entsprechenden Fällen zu melden, die in Kapitel 3.2 für Repos erläutert werden.

*Beispiel:*

- 1) Meldung eines Open Reverse Securities Loans mit Handelstag T und an T+2 abzuwickelndem Cash Collateral, das mit einer Kündigungsfrist von einem Tag zurückgekauft

---

<sup>26</sup> Spätere Meldesätze für Open Repos sollen jeweils die bei Vertragsabschluss ursprünglich vereinbarten Angaben widerspiegeln, es sei denn, wesentliche Konditionen wie der Zinssatz oder das Transaktionsvolumen werden verändert. In diesem Fall sollen die neuen Konditionen analog zu anderen Neuverhandlungen gemeldet werden. Sofern insbesondere keine Neuverhandlung vorliegt, sollen Sicherheitenattribute wie der COLLATERAL NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Sicherheit), der COLLATERAL HAIRCUT (Sicherheitsabschlag), die COLLATERAL TYPE (Art der Sicherheit) sowie der COLLATERAL ISSUER SECTOR (Sektor des Emittenten der Sicherheit) nicht überarbeitet werden, wenn die Änderungen sich u. a. aus Margin Calls, dem Austausch von Sicherheiten oder Marktwertveränderungen der Sicherheit ergeben.

(beendet/geschlossen/gekündigt) werden kann. An T+28 vereinbaren die beiden Gegenparteien, den Open Reverse Securities Loan zu schließen. Die Parteien vereinbaren, dass die verliehenen Sicherheiten größtenteils aus Staatsanleihen bestehen sollen. Die Abwicklung der Wertpapiere erfolgt FOP (Free of Payment).

Tag	Handels-tag	Abwick-lungstag	Fällig-keitstag	PTI	Anmerkungen
T	T	T+2	T+3	„1“	Neuer Open Reverse Securities Loan mit Abwicklung des Cash Collaterals an T+2 und einer Kündigungsfrist von einem Tag. Details zur Transaktion: <ul style="list-style-type: none"> <li>• Transaction Nominal Amount: 1.000.000 EUR (analog zum Cash Collateral)</li> <li>• Collateral Type = DBXXXX</li> <li>• Collateral Issuer Sector = S13</li> </ul> Der Abwicklungstag für die Wertpapiere ist für die Meldung irrelevant.
T+1				–	Keine Meldung
T+2				–	Keine Meldung
T+3	T+3	T+3	T+4	„2“	Rollover des Open Reverse Securities Loans. Änderungen von Transaktionsdetails sind im gemeldeten Rollover unter Beachtung der vorstehend dargelegten Regeln für die Meldung von Rollovers für BAW-Repogeschäfte.
T+4	T+4	T+4	T+5	„3“	Rollover des Open Reverse Securities Loans. Meldung der gleichen Transaktionsdetails wie für PTI 1.
...	...	...	...	...	
T+28	T+28	T+28	T+29	„27“	Die cash-gebende Gegenpartei kündigt den Reverse Securities Loan und fordert die Rückzahlung des Cashs an T+29. Die Rückgabe der verliehenen Sicherheiten erfolgt FOP (Free of Payment), sobald die geldgebende Gegenpartei den Cash-Erhalt bestätigen und ihre Übertragung veranlassen kann.
T+29	Keine Meldung			–	Beendigung des Geschäfts

### 3.4 Variablen im besicherten Marktsegment

Die für jede besicherte, auf Euro lautende Transaktion zu meldenden Variablen sind in der folgenden Tabelle aufgeführt. Nicht alle Variablen und Elemente, die im XML-Schema nach ISO 20022 für das besicherte Marktsegment enthalten sind, finden derzeit in der Geldmarktstatistik Anwendung. Insbesondere die Variablen BRANCH IDENTIFICATION und BROKERED DEAL sowie der Block „NameAndLocation“, der Teil des Blocks „CounterpartyIdentification“ der Meldung ist, werden aktuell nicht für die Geldmarktstatistik genutzt und demzufolge nicht in der folgenden Tabelle aufgeführt.

Name der Variablen	Beschreibung
REPORTED TRANSACTION STATUS (Transaktionsstatus)	Diese Variable enthält Informationen über den Status der Transaktion, d. h. darüber, ob es sich um eine neue Transaktion, ein Amendment einer früher gemeldeten Transaktion, eine Cancellation einer früher gemeldeten Transaktion oder eine Correction einer bereits gemeldeten und abgewiesenen Transaktion handelt.
NOVATION STATUS (Novationsstatus)	Diese Variable spezifiziert, ob es sich bei der Transaktion um eine Novation handelt, d. h. um eine Transaktion, bei der u. a. die Gegenpartei geändert wurde. Änderungen der Gegenpartei aufgrund von Geschäftsvorfällen (wie z. B. Fusionen) sind nicht als Novationen zu melden.  <i>Liegt eine Novation vor, ist dieses Feld ein Pflichtfeld.</i>
UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER (Eindeutige Transaktionskennung; UTI)	Diese Variable enthält die UTI, bei der es sich um eine eindeutige Kennziffer zur Identifikation einer Transaktion in dem jeweiligen Marktsegment handelt.  <i>Zu melden, sofern zum Zeitpunkt der Einreichung der Geldmarktstatistik verfügbar.</i>
PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung; PTI)	Diese Kennung ist die eindeutige interne Transaktionskennung, die der Berichtspflichtige für jede Transaktion verwendet. Die PTI, die für jede Transaktion zu übermitteln ist und mit der diese identifiziert werden kann, muss pro Marktsegment und Berichtspflichtigem einmalig sein.
RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Zugehörige interne Transaktionskennung)	Bei dieser Variable handelt es sich um die eindeutige interne Transaktionskennung, die der Berichtspflichtige für die ursprüngliche Transaktion verwendet, die durch eine Novation ersetzt wurde.  <i>Liegt eine Novation vor, ist dieses Feld ein Pflichtfeld.</i>
COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION	Diese Variable enthält die derselben Transaktion von der Gegenpartei des Berichtspflichtigen zugewiesene PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung; PTI).

Name der Variablen	Beschreibung
IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung der Gegenpartei)	<i>Bei Verfügbarkeit zu melden.</i>
COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei)	<p>Diese Variable enthält die LEI der Gegenpartei des Berichtspflichtigen.</p> <p>Dieses Feld ist ein Pflichtfeld für alle Gegenparteien, die über eine LEI verfügen. Handelt es sich bei der Gegenpartei um eine Zweigniederlassung, ist die LEI der Muttergesellschaft, d. h. des Rechtsträgers, der die Zweigniederlassung gegründet hat und kontrolliert, zu melden. Wird die Transaktion über eine CCP (Central Clearing Counterparty) abgeschlossen, ist in diesem Feld die LEI der CCP zu melden.</p> <p>In allen anderen Fällen, z. B. wenn die Gegenpartei über keine LEI verfügt, darf diese Variable nicht im XML-Schema enthalten sein, und es sind stattdessen der COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei) und die COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei) zu melden.</p> <p>Diese Variable wird in der MMSR message als „LEI“ bezeichnet und befindet sich im Block „CounterpartyIdentification“.</p>
COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei)	<p>Mit dieser Variablen wird der Sektor der Gegenpartei, z. B. nichtfinanzielle Kapitalgesellschaft oder Zentralbank, angegeben.</p> <p><i>Der COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei) ist für alle Transaktionen zu melden, bei denen die COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei) nicht angegeben ist.</i></p> <p>Diese Variable wird in der MMSR message als „Sector“ bezeichnet und befindet sich im Block „SectorAndLocation“ des Blocks „CounterpartyIdentification“.</p>
COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei)	<p>Diese Variable beinhaltet den ISO-Ländercode des Landes, in dem die Gegenpartei ihren Sitz hat.</p> <p><i>Die COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei) ist für alle Transaktionen zu melden, bei denen die COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei) nicht angegeben ist.</i></p> <p>Diese Variable wird in der MMSR message als „Location“ bezeichnet und befindet sich im Block „SectorAndLocation“ des Blocks „CounterpartyIdentification“.</p>
TRIPARTY AGENT IDENTIFICATION (Kennung des Tri-Party-Agents)	<p>Als Kennung für Tri-Party-Agents wird deren LEI gemeldet.</p> <p><i>Dieses Feld ist ein Pflichtfeld für alle Tri-Party-Transaktionen. Für andere Arten von Transaktionen ist dieses Feld nicht anzugeben.</i></p>
TRADE DATE	Beim Handelstag handelt es sich um den Tag und die Uhrzeit, an denen die

Name der Variablen	Beschreibung
(Handelstag)	<p>Parteien die gemeldete Transaktion vereinbart haben. Sollte die Uhrzeit der Transaktion nicht verfügbar sein, ist nur deren Datum zu melden.</p> <p>Die zu meldende Uhrzeit ist die Ausführungszeit (sofern verfügbar) oder ansonsten die Zeit, zu der die Transaktion im Buchungssystem des Berichtspflichtigen erfasst wird. Die Zeit ist stets als realer Zeitpunkt und nicht als Standardwert (z. B. Mitternacht) anzugeben.</p> <p>Das TRADE DATE (Handelstag) hat stets an oder vor dem SETTLEMENT DATE (Abwicklungstag) zu liegen. Ausnahmen sind lediglich bei Novationen oder in den Fällen zulässig, in denen die Gegenparteien eine vor dem TRADE DATE beginnende Verzinsung vereinbart haben. Trifft eine der beiden Ausnahmen zu, kann ein nach dem SETTLEMENT DATE liegendes TRADE DATE gemeldet werden.</p>
SETTLEMENT DATE (Abwicklungstag)	<p>Dies ist der Tag des ursprünglichen Austauschs von Cash gegen Sicherheit wie vertraglich vereinbart. Bei Reverse Securities Loans handelt es sich um den Tag, an dem die Lieferung des Cash Collateral erfolgen soll. Im Falle einer Verlängerung (Rollover) von Transaktionen bezeichnet der Abwicklungstag den Tag, an dem der Rollover durchgeführt wird, auch wenn kein Austausch von Cash stattfindet. Findet die Abwicklung an einem anderen Tag statt als ursprünglich vereinbart, ist kein Amendment der Transaktion zu melden.</p>
MATURITY DATE (Fälligkeitstag)	<p>Diese Variable bezeichnet den Rückkaufstag, d. h. den Tag, an dem das Cash im Austausch gegen den als Sicherheit hinterlegten oder erhaltenen Vermögenswert zurückzuzahlen bzw. fällig ist.</p> <p>BAW-Repogeschäfte und BAW-Reverse Securities Loans sind grundsätzlich mit einer Overnight-Fälligkeit zu melden. In Ausnahmefällen ist im Falle von Open Repos mit einer Kündigungsfrist, die über die konventionelle oder obligatorische Abwicklungsfrist von Sicherheiten hinausgeht (Open Evergreens), der Tag, an dem das Geschäft frühestens beendet werden kann, als Fälligkeitstag zu melden. Bei Fixed Term Evergreens hat der Fälligkeitstag dem Tag zu entsprechen, an dem das Geschäft frühestens beendet werden kann und nicht das fest vereinbarte Ende des Geschäfts. Bei BAW-Reverse Securities Loans mit einer Kündigungsfrist von über einem Tag ist der Tag, an dem das Geschäft frühestens beendet werden kann, als Fälligkeitstag zu melden.</p>
TRANSACTION TYPE (Art der Transaktion)	<p>Diese Variable gibt an, ob es sich bei der Transaktion aus Sicht des Berichtspflichtigen um eine Geldvergabe („LEND“) oder Geldaufnahme („BORR“) handelt.</p>
TRANSACTION NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Transaktion)	<p>Der Nennwert der Transaktion ist der Absolutbetrag (in Euro), der ursprünglich aufgenommen oder vergeben wurde. In der MMSR message muss angegeben werden, dass die Währung Euro ist. Bei Reverse Securities Loans bezieht sich der Nennwert der Transaktion auf das Cash Collateral in Euro.</p>

Name der Variablen	Beschreibung
RATE TYPE (Art des Zinssatzes)	Diese Variable gibt an, ob für die Transaktion ein Festzins- oder variabler Zinssatz vereinbart wurde.
DEAL RATE (Zinssatz der Transaktion)	<p>Diese Variable bezeichnet den Zinssatz gemäß der ACT/360-Geldmarktkonvention, zu dem das Repogeschäft, das Sell/Buy-Back-Geschäft oder der Reverse Securities Loan abgeschlossen wurden und zu dem das aufgenommene oder bereitgestellte Cash verzinst wird.</p> <p>Berichtspflichtig sind nur tatsächlich zu zahlende Zinssätze, keine Schätzungen oder Standardwerte.</p> <p>Der Zinssatz kann entweder positiv oder negativ sein, unabhängig davon, ob das Cash aufgenommen oder bereitgestellt wird. Er stellt den vereinbarten Satz dar, zu dem der Nennwert der Transaktion vergütet wird, und zwar unabhängig von der Lieferrichtung der Cash-Seite zu Beginn des Geschäfts (d. h. ob der TRANSACTION TYPE (Art der Transaktion) als „LEND“ oder „BORR“ gemeldet wird).</p> <p><i>Dieses Feld ist nur bei Geschäften mit festverzinslichen Instrumenten zu melden.</i></p>
REFERENCE RATE INDEX (Referenzzinssatz)	<p>Diese Variable beschreibt den ISIN-Code des zugrunde liegenden Referenzzinssatzes, auf dessen Grundlage die periodischen Zinszahlungen berechnet werden.</p> <p>Eine vollständige Liste der ISIN-Codes für die verschiedenen REFERENCE RATE INDICES (Referenzzinssätze) findet sich in Anhang IV.</p> <p><i>Dieses Feld ist nur bei Repogeschäften mit variabler Verzinsung und variabel verzinslichen Reverse Securities Loans zu melden.</i></p> <p>Diese Variable befindet sich im Block „FloatingRateRepurchaseAgreement“ der MMSR message.</p>
BASIS POINT SPREAD (Spread in Basispunkten)	<p>Diese Variable gibt die Anzahl der Basispunkte an, die auf den zugrunde liegenden Referenzzinssatz aufgeschlagen (bei einem positiven Wert) oder von diesem abgezogen (bei einem negativen Wert) werden, um bei Abschluss des Repogeschäfts mit variabler Verzinsung oder variabel verzinslichen Reverse Securities Loans den tatsächlichen Zinssatz für einen bestimmten Zeitraum zu ermitteln.</p> <p><i>Dieses Feld ist nur bei Repogeschäften mit variabler Verzinsung und variabel verzinslichen Reverse Securities Loans zu melden.</i></p> <p>Diese Variable befindet sich im Block „FloatingRateRepurchaseAgreement“ der MMSR message.</p>
COLLATERAL ISIN (ISIN der Sicherheit(en))	Diese Variable spezifiziert die International Securities Identification Number (ISIN) der in der Transaktion verwendeten Sicherheit(en).

Name der Variablen	Beschreibung								
	<p>Je nach der Transaktion ist eine der folgenden Optionen zu melden:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>(a) Bei Single-Collateral-Geschäften ist die ISIN der einzigen verwendeten Sicherheit zu melden.</li> <li>(b) Bei Multiple-Collateral-Geschäften sind alle individuellen ISINs der jeweils verwendeten Sicherheiten zu melden.</li> <li>(c) Bei Tri-Party-Collateral-Geschäften, bei denen der Pool oder -Basket der zulässigen Wertpapiere über eine generische/Pseudo-/synthetische ISIN identifiziert werden kann, ist diese ISIN zu melden.</li> </ul> <p>Das Feld bezieht sich auf das „ISIN“-Element des XML-Schemas der MMSR message. Der XML-Pfad innerhalb der Meldung gibt darüber Aufschluss, welcher der drei obigen Fälle a) bis c) für die Transaktion zum Tragen kommt. Das Element <b>MltplColl</b> kann mehrfach gemeldet werden, um die Angabe mehrerer ISINs zu ermöglichen.</p> <p>Mögliche XML-Pfade für das ISIN-Element je nach Transaktionsart:</p> <table border="1" data-bbox="571 936 1310 1223"> <thead> <tr> <th>Art der Transaktion</th> <th>XML-Pfad</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>(a) Single Collateral</td> <td>/Coll/Valtn/<b>SnglColl</b>/ISIN</td> </tr> <tr> <td>(b) Multiple Collateral</td> <td>/Coll/Valtn/<b>MltplColl</b>/ISIN</td> </tr> <tr> <td>(c) Generische ISIN (Basket)</td> <td>/Coll/Valtn/<b>PoolColl</b>/ISIN</td> </tr> </tbody> </table> <p><i>Dieses Feld ist nicht zu melden für</i></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>(1) <i>Tri-Party-Repos, die mit einem Basket von Sicherheiten besichert sind, das nicht über eine generische ISIN verfügt (siehe Kapitel 3.1).</i></li> <li>(2) <i>Arten von Sicherheiten, die nicht über eine ISIN verfügen.</i></li> <li>(3) <i>Reverse Stock Loans/Reverse Securities Loans.</i></li> </ul> <p><i>In diesen drei Fällen sind stattdessen die Felder COLLATERAL TYPE (Art der Sicherheit), COLLATERAL ISSUER SECTOR (Sektor des Emittenten der Sicherheit) und COLLATERAL POOL STATUS (Sicherheitenpool) zu melden.</i></p>	Art der Transaktion	XML-Pfad	(a) Single Collateral	/Coll/Valtn/ <b>SnglColl</b> /ISIN	(b) Multiple Collateral	/Coll/Valtn/ <b>MltplColl</b> /ISIN	(c) Generische ISIN (Basket)	/Coll/Valtn/ <b>PoolColl</b> /ISIN
Art der Transaktion	XML-Pfad								
(a) Single Collateral	/Coll/Valtn/ <b>SnglColl</b> /ISIN								
(b) Multiple Collateral	/Coll/Valtn/ <b>MltplColl</b> /ISIN								
(c) Generische ISIN (Basket)	/Coll/Valtn/ <b>PoolColl</b> /ISIN								
COLLATERAL POOL STATUS (Sicherheitenpool)	<p>Dieses Feld ist nur bei Transaktionen zu verwenden, bei denen das Feld COLLATERAL ISIN (ISIN der Sicherheit(en)) nicht gemeldet wird. Es gibt an, welche Art von Informationen in den Feldern COLLATERAL TYPE (Art der Sicherheit) und COLLATERAL ISSUER SECTOR (Sektor des Emittenten der Sicherheit) gemeldet werden:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Wird als COLLATERAL POOL STATUS die Ausprägung „POOL“ gemeldet, beziehen sich die für die Felder COLLATERAL TYPE und COLLATERAL ISSUER SECTOR gemeldeten Werte auf die Pool-/Basket-Ebene. Dies gilt sowohl für Tri-Party-General-Collateral-Repos</li> </ul>								

Name der Variablen	Beschreibung		
	<p>als auch für Reverse Securities Loans (mit und ohne Tri-Party-Agents), bei denen der Basket/Pool der zu verwendenden Sicherheiten nicht über eine generische ISIN verfügt.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Wird als COLLATERAL POOL STATUS die Ausprägung „NOPL“ gemeldet, beziehen sich die in den Feldern COLLATERAL TYPE und COLLATERAL ISSUER SECTOR gemeldeten Werte auf einzelne Sicherheiten. Dies gilt für Single- und Multiple-Collateral-Geschäfte, die mit einzelnen Vermögenswerten besichert sind, die nicht über einen ISIN-Code verfügen.</li> </ul> <p>Das jeweilige XML-Element befindet sich in der MMSR message an folgender Stelle:</p> <p>XML-Pfad für das „PoolSts“-Element</p> <table border="1" data-bbox="571 813 1002 956"> <tr> <td data-bbox="571 813 1002 887">XML-Pfad</td> </tr> <tr> <td data-bbox="571 887 1002 956">/Coll/Valtn/OthrColl/PoolSts</td> </tr> </table> <p>Werden einzelne oder generische ISINs gemeldet, ist dieses Feld nicht zu melden. Stattdessen ist das Element COLLATERAL ISIN zu integrieren. Der unter COLLATER ISIN beschriebene Fall (c) gilt für Sicherheitenpools mit einer generischen ISIN.</p>	XML-Pfad	/Coll/Valtn/OthrColl/PoolSts
XML-Pfad			
/Coll/Valtn/OthrColl/PoolSts			
<p>COLLATERAL TYPE (Art der Sicherheit(en))</p>	<p>Dieses Feld ist nur bei Transaktionen zu verwenden, bei denen das Feld COLLATERAL ISIN (ISIN der Sicherheit(en)) nicht gemeldet wird. Es gibt den jeweiligen CFI-Code für folgende Fälle an:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Bei Tri-Party-General-Collateral-Geschäften, bei denen der Basket/Pool der verwendbaren Sicherheiten nicht über eine generische ISIN verfügt, ist der CFI-Code der Sicherheitenklasse zu melden, die die für das Geschäft zu verwendende Klasse der Sicherheiten am besten repräsentiert. Dasselbe gilt für Reverse Securities Loans (mit und ohne Tri-Party-Agent).</li> <li>In allen anderen Fällen ist der CFI-Code des/der einzelnen Sicherheit(en) zu melden, für die kein ISIN-Code vorliegt. Bei Multiple-Collateral-Geschäften kann dieses Feld mehrfach gemeldet werden, um unterschiedliche CFI-Codes abzubilden.</li> </ul> <p>Diese Variable befindet sich in der MMSR message an folgender Stelle:</p> <p>XML-Pfad für das „Tp“-Element</p> <table border="1" data-bbox="571 1845 1002 1989"> <tr> <td data-bbox="571 1845 1002 1919">XML-Pfad</td> </tr> <tr> <td data-bbox="571 1919 1002 1989">/Coll/Valtn/OthrColl/Tp</td> </tr> </table>	XML-Pfad	/Coll/Valtn/OthrColl/Tp
XML-Pfad			
/Coll/Valtn/OthrColl/Tp			

Name der Variablen	Beschreibung		
	<p>Werden einzelne oder generische ISINs gemeldet, darf dieses Feld nicht in der MMSR message enthalten sein. Stattdessen ist/sind das/die Element(e) COLLATERAL ISIN zu integrieren.</p>		
<p>COLLATERAL ISSUER SECTOR (Sektor des Emittenten der Sicherheit(en))</p>	<p>Dieses Feld ist nur bei Transaktionen zu verwenden, bei denen das Feld COLLATERAL ISIN (ISIN der Sicherheit(en)) nicht gemeldet wird. Es gibt Folgendes an:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• bei Tri-Party-General-Collateral-Geschäften, bei denen der Basket/Pool der verwendbaren Sicherheiten nicht über eine generische ISIN verfügt, den Sektor des Emittenten, der den größten Anteil an den Emittenten der verwendbaren Sicherheiten ausmacht. Dasselbe gilt für Reverse Securities Loans (mit und ohne Tri-Party-Agent).</li> <li>• in allen anderen Fällen den Sektor des Emittenten der einzelnen Sicherheit, für die keine ISIN vorliegt. Bei Multiple-Collateral-Geschäften kann dieses Feld mehrfach gemeldet werden, um unterschiedliche Emittentensektoren abzubilden.</li> </ul> <p>Diese Variable beschreibt den Sektor des Emittenten der Sicherheit, z. B. Staat, Zentralbank.</p> <p>Diese Variable befindet sich in der Meldung zur Geldmarktstatistik an folgender Stelle:</p> <p style="text-align: center;">XML-Pfad für das „Sctr“-Element</p> <table border="1" style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td style="padding: 5px;">XML-Pfad</td> </tr> <tr> <td style="padding: 5px;">/Coll/Valtn/OthrColl/Sctr</td> </tr> </table> <p>Werden einzelne oder generische ISINs gemeldet, darf dieses Feld nicht in der MMSR message enthalten sein.</p>	XML-Pfad	/Coll/Valtn/OthrColl/Sctr
XML-Pfad			
/Coll/Valtn/OthrColl/Sctr			
<p>SPECIAL (or SPECIFIC) COLLATERAL INDICATOR (Kennzeichen für special/specific Collateral)</p>	<p>Diese Variable gibt an, ob die Transaktion gegen allgemeine oder andere Sicherheiten abgeschlossen wurde.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Eine allgemeine Sicherheit („general Collateral“) bezeichnet eine Sicherheit für eine Transaktion, bei der der Sicherheitsgeber ein oder mehrere Sicherheiten aus einer relativ breiten Klasse, die vorher festgelegte Kriterien erfüllt, als Sicherheit für den Geldgeber aussuchen kann;</li> <li>- Bei einem special oder specific Collateral für eine Transaktion sind vom Sicherheitsgeber hingegen ein oder mehrere konkrete Wertpapiere (mit individueller ISIN) an den Geldgeber zu liefern.</li> </ul>		

Name der Variablen	Beschreibung										
	<p>„Matched and Reverse Repurchase Agreement“ bezeichnet ein Paar von aufeinanderfolgenden Transaktionen (Back-to-back-Geschäft), das aus einem Repogeschäft und einem Reverse-Repogeschäft besteht, das Ziel der Cash-Neutralität verfolgt und so die Eigenschaften eines Wertpapierdarlehens gegen Wertpapiersicherheiten aufweist. <i>Dieses Feld ist optional, sollte jedoch gemeldet werden, sofern dies für den Berichtspflichtigen darstellbar ist.</i></p> <p>Diese Variable befindet sich im Block „Collateral“ der MMSR message.</p>										
<p>COLLATERAL NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Sicherheit(en))</p>	<p>In dieser Variable wird der Nennwert der Sicherheit(en) in Euro gemeldet. Bei einer Anleihe entspricht dieser dem Nennwert der Anleihe, die als Sicherheit für das Geschäft verwendet wird.</p> <p>Dieses Feld ist optional, sofern es sich um ein Tri-Party-Repogeschäft, Reverse Stock Loans/Reverse Securities Loans und Transaktionen handelt, bei denen die Sicherheit(en) nicht über ISIN-Codes zu identifizieren ist bzw. sind.</p> <p>Dieses Feld kann wiederholt gemeldet werden, wenn mehrere Wertpapiere als Sicherheiten für die Transaktion gestellt werden. Im Falle eines Multiple-Collateral-Repogeschäfts ist der Nennwert jeder Sicherheit zu melden.</p> <p>Am Berichtstag ist der Gesamtbetrag als absoluter Wert (d. h. als nichtnegativer Wert) in Euro zu melden.</p> <p>Wird als Sicherheit ein Asset-Backed Security (ABS) verwendet, ist die Variable durch die Multiplikation des Nennwerts der Sicherheit mit dem entsprechenden Pool-Faktor zu berechnen. Im Falle von Aktien (einschließlich börsengehandelter Fonds (ETFs)) ist die Variable durch die Multiplikation der Anzahl von Aktien/Anteilen mit ihrem jeweiligen Kurs/Preis zu berechnen.</p> <p>Mögliche XML-Pfade für das „NmnlAmt“-Element je nach Transaktionsart:</p> <table border="1" data-bbox="571 1379 1347 1818"> <thead> <tr> <th data-bbox="571 1379 906 1451">Art der Transaktion</th> <th data-bbox="906 1379 1347 1451">XML-Pfad</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="571 1451 906 1523">(a) Single Collateral</td> <td data-bbox="906 1451 1347 1523">/Coll/Valtn/<b>SnglColl</b>/NmnlAmt</td> </tr> <tr> <td data-bbox="571 1523 906 1594">(b) Multiple Collateral</td> <td data-bbox="906 1523 1347 1594">/Coll/Valtn/<b>MltplColl</b>/NmnlAmt</td> </tr> <tr> <td data-bbox="571 1594 906 1706">(c) Generische ISIN (Basket)</td> <td data-bbox="906 1594 1347 1706">/Coll/Valtn/<b>PoolColl</b>/NmnlAmt</td> </tr> <tr> <td data-bbox="571 1706 906 1818">(d) Sicherheiten ohne ISIN</td> <td data-bbox="906 1706 1347 1818">/Coll/Valtn/<b>OthrColl</b>/NmnlAmt</td> </tr> </tbody> </table> <p>In der MMSR message ist zu spezifizieren, dass die Währung Euro ist.</p>	Art der Transaktion	XML-Pfad	(a) Single Collateral	/Coll/Valtn/ <b>SnglColl</b> /NmnlAmt	(b) Multiple Collateral	/Coll/Valtn/ <b>MltplColl</b> /NmnlAmt	(c) Generische ISIN (Basket)	/Coll/Valtn/ <b>PoolColl</b> /NmnlAmt	(d) Sicherheiten ohne ISIN	/Coll/Valtn/ <b>OthrColl</b> /NmnlAmt
Art der Transaktion	XML-Pfad										
(a) Single Collateral	/Coll/Valtn/ <b>SnglColl</b> /NmnlAmt										
(b) Multiple Collateral	/Coll/Valtn/ <b>MltplColl</b> /NmnlAmt										
(c) Generische ISIN (Basket)	/Coll/Valtn/ <b>PoolColl</b> /NmnlAmt										
(d) Sicherheiten ohne ISIN	/Coll/Valtn/ <b>OthrColl</b> /NmnlAmt										
<p>COLLATERAL HAIRCUT (or INITIAL MARGIN)</p>	<p>Diese Variable enthält entweder den Haircut (Sicherheitsabschlag) oder die Initial Margin, die bei Aufnahme des Geschäfts vereinbart wurden.</p>										

Name der Variablen	Beschreibung
(Sicherheits-Abschlag (oder Initial Margin))	<p>Ein Haircut oder eine Initial Margin ist eine Risikokontrollmaßnahme zur Anpassung des Wertes der Sicherheit einer bestimmten Transaktion, um dem Empfänger der Sicherheit einen Puffer für den Fall einzuräumen, dass bei einem möglichen Ausfall der Gegenpartei die Liquidierung der Sicherheit erforderlich wird.</p> <p>Auch wenn sie weitestgehend analog wirken, werden Sicherheitsabschläge und Initial Margins auf unterschiedlicher Basis gemeldet:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Haircuts werden als prozentualer Abschlag auf den initialen Marktwert der Sicherheit gemeldet.</li> <li>• Die Initial Margin wird in der Regel als Prozentsatz des in der Transaktion ausgetauschten Kaufpreises (Cash) angegeben.</li> </ul> <p>Unabhängig davon, ob ein Haircut oder eine Initial Margin vereinbart wurde, ist er zu Meldezwecken als Haircut-Prozentsatz auszuweisen. Die folgende Formel kann zur Berechnung verwendet werden:</p> <p><i>COLLATERAL HAIRCUT OR INITIAL MARGIN (ausgewiesen als Haircut-Prozentsatz) =</i></p> <p><i>100 – (zu Beginn des Geschäfts vergebenes oder aufgenommenes Cash / Marktwert der Sicherheit zu Beginn des Geschäfts, einschließlich Zinsen) * 100</i></p> <p>So ist z. B. für einen Haircut von 5 % der Wert „5“ und für eine Initial Margin von 105 % der Wert „4.76“ zu melden. Eine Initial Margin von 105 % wird also als Haircut-Prozentsatz von 4,76 % ausgewiesen.</p> <p>Wenn zur Meldung dieses Felds die obige Formel verwendet wird, sollte das Berechnungsergebnis, das sich zu Beginn des Geschäfts ergibt, für das gesamte Geschäft gemeldet werden. Dies gilt sowohl für Geschäfte mit fester Laufzeit als auch für Bis-auf-Weiteres-Geschäfte.</p> <p>Bei einigen wertpapier-getriebenen Geschäften kann der Feldwert negativ sein, was bedeutet, dass die Gegenpartei, die zu Beginn des Geschäfts die Sicherheit bereitstellt, dafür einen höheren Cash-Betrag als den Marktwert der Sicherheit erhält.</p> <p>Im Falle von Multiple-Collateral-Repogeschäften wird der obigen Formel die Summe aus den Marktwerten der einzelnen für die Transaktion als Sicherheiten verwendeten Wertpapiere zugrunde gelegt. So wird für die gesamte Transaktion ein gewichteter durchschnittlicher Haircut angegeben.</p> <p>In diesem Feld nicht meldepflichtig sind:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Initial Margins, die einer CCP gestellt werden mussten. Grundsätzlich werden alle Geschäfte, die über eine CCP abgewickelt werden, mit einem COLLATERAL HAIRCUT von 0 gemeldet.</li> <li>• Haircuts, die auf Sicherheiten der Variation Margin angewendet werden.</li> </ul>

Name der Variablen	Beschreibung
	<p><i>Die Meldung dieses Feldes ist nur für Transaktionen mit einer einzigen Sicherheit verpflichtend. In allen anderen Fällen, z. B. bei Tri-Party-Repogeschäften, Reverse Securities Loans und in allen Fällen, in denen eine besicherte Geldaufnahme/Geldvergabe gegen einen Sicherheitenpool stattfindet, ist eine Meldung optional.</i></p> <p>Diese Variable befindet sich im Block „Collateral“ der MMSR message und wird als „Haircut“ bezeichnet.</p>

### 3.5 Felddefinitionen für das besicherte Marktsegment (Tabelle 1)

Variable	Name der Variablen	Art	Beispiel
S0	REPORTED TRANSACTION STATUS (Transaktionsstatus)	Zeichenkette. Länge: 4 CL_REPORTED_TRANSACTION_STATUS (siehe Anhang I)	
S15	NOVATION STATUS (Novationsstatus)	Zeichenkette. Länge: 4 CL_NOVATION_STATUS (siehe Anhang 1)	„NOVA“ steht für „Transaktion ist eine Novation“.
S10	UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER (Eindeutige Transaktionskennung; UTI)	Zeichenkette. Maximale Länge: 105 Eindeutige Transaktionskennung (UTI) Bis zu 105 alphanumerische Zeichen Es sind vier Sonderzeichen zulässig: „.“, „.“, „-“, „_“ Am Anfang und am Ende sind keine Sonderzeichen zulässig. Keine Leerzeichen zulässig.	
S20	PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktions- kennung; PTI)	Zeichenkette. Maximale Länge: 105 Eindeutige Identifikationsnummer für Transaktionen je Berichtspflichtigem und Marktsegment.	
S35	RELATED PROPRIETARY	Zeichenkette. Maximale Länge: 105	

Variable	Name der Variablen	Art	Beispiel
	TRANSACTION IDENTIFICATION (Zugehörige interne Transaktionskennung)		
S30	COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung der Gegenpartei)	Zeichenkette. Maximale Länge: 105	
S40	COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei)	Zeichenkette. Länge: 20 Der <b>Legal Entity Identifier (LEI; Rechtsträgerkennung)</b> ist ein 20-stelliger alphanumerischer Code, der mit wichtigen Referenzinformationen verknüpft ist und eine klare und eindeutige Identifizierung von Unternehmen ermöglicht, die an den globalen Finanzmärkten agieren. [ISO 17442]	„QS3ZEAHRBZY9228 Z0111“ ist die LEI der Commerzbank International S.A.
S50	COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei)	Zeichenkette. Maximale Länge: 4 Bezieht sich auf die institutionellen Sektoren nach ESVG 2010 <sup>27</sup> CL_COUNTERPARTY_SECTOR (siehe Anhang I)	„S11“ steht für „Nichtfinanzielle Kapitalgesellschaft“.
S60	COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei)	Zeichenkette. Länge: 2 [ISO 3166-1 Alpha-2] CL_COUNTRY (siehe Anhang I)	„DE“ steht für Deutschland.
S70	TRI-PARTY AGENT IDENTIFICATION	Identisches Format wie COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei)	

<sup>27</sup> Die vollständige Liste der institutionellen Sektoren nach ESVG 2010 kann im Eurostat-Bereich der Website der Europäischen Kommission unter „www.europa.eu“ abgerufen werden.

Variable	Name der Variablen	Art	Beispiel
	(Kennung des Tri-Party-Agents)		
S80	TRADE DATE (Handelstag)	Tag und Uhrzeit [ISO 8601] YYYY-MM-DDThh:mm:ss+/-hh:mm <i>oder</i> YYYY-MM-DDThh:mm:ss.sss+/-hh:mm Die Angabe der Zeitzone („+/-hh:mm“) muss stets enthalten sein. Lokale Zeitformate (d. h. ohne „+/-hh:mm“) sind nicht zulässig; <i>oder</i> Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD Das Datum muss stets der MEZ-Zeitzone entsprechen.	„2014-11-26T09:00:00+00:00“ steht für den 26. November 2014 um 9.00 Uhr lokale Zeit (GMT) <i>oder</i> „2014-11-26“ steht für den 26. November 2014 (MEZ).
S90	SETTLEMENT DATE (Abwicklungstag)	Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD Das Datum muss stets der MEZ-Zeitzone entsprechen.	„2014-11-26“ steht für den 26. November 2014 (MEZ).
S100	MATURITY DATE (Fälligkeitstag)	Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD Das Datum muss stets der MEZ-Zeitzone entsprechen.	„2014-11-26“ steht für den 26. November 2014 (MEZ).
S110	TRANSACTION TYPE (Art der Transaktion)	Zeichenkette. Länge: 4 CL_TRANSACTION_TYPE (siehe Anhang I)	„BORR“ steht für Geldaufnahme. „LEND“ steht für Geldvergabe.
S120	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Transaktion)	Numerisch. Maximale Gesamtlänge: 18 Positive Zahl Dezimalstellen: bis zu 5 Währung [ISO 4127]	1000000 EUR, wobei „EUR“ für Euro steht. Die gemeldete Währung muss stets Euro sein.

Variable	Name der Variablen	Art	Beispiel
S130	RATE TYPE (Art des Zinssatzes)	Zeichenkette. Länge: 4 CL_RATE_TYPE (siehe Anhang I)	„VARI“ steht für einen variablen Zinssatz.
S140	DEAL RATE (Zinssatz der Transaktion)	Numerisch. Maximale Gesamtlänge: 11 Positive oder negative Zahl Dezimalstellen: bis zu 10 Einheit: Prozentpunkte	„10.234“ steht für einen Zinssatz der Transaktion von 10,234 %.
S150	REFERENCE RATE INDEX (Referenzzinssatz)	Zeichenkette. Länge: 12 ISIN des Basiswerts [ISO 6166]	„EU0009652783“ steht für den 3-Monats-EURIBOR.
S160	BASIS POINT SPREAD (Spread in Basispunkten)	Numerisch. Maximale Gesamtlänge: 18 Positive oder negative Zahl Dezimalstellen: 0 Einheit: Basispunkte	1023 steht für einen Spread von 10,234 %. Da die Einheit Basispunkte ist, werden die 10,234 % hier zunächst auf 10,23 % gerundet und dann in 1023 umgewandelt. Es wird stets auf die nächste ganze Zahl gerundet, d. h. 1,5 wird als 2 gemeldet und –1,5 wird als –1 gemeldet.
S170	COLLATERAL ISIN (ISIN der Sicherheit(en))	Zeichenkette. Länge: 12 Dieser Block wird mehrfach verwendet, wenn es mehrere Sicherheiten gibt. [ISO 6166]	„DE000ENAG999“ steht für Aktien von E.ON.
S180	COLLATERAL POOL (Sicherheitenpool)	Zeichenkette. Länge: 4 CL_COLLATERAL_POOL (siehe Anhang I)	„POOL“ steht für einen Sicherheitenpool.
S190	COLLATERAL TYPE (Art der Sicherheit(en))	Zeichenkette. Länge: 6 Der CFI-Code (Classification of Financial Instrument Code) ist zur Identifizierung der Art der Sicherheit anzugeben. [ISO 10962]	„ESXXXX“ steht für Aktien/Geschäftsanteile.

Variable	Name der Variablen	Art	Beispiel
S200	COLLATERAL ISSUER SECTOR (Sektor des Emittenten der Sicherheit(en))	Zeichenkette. Maximale Länge: 4 Bezieht sich auf die institutionellen Sektoren nach ESVG 2010. CL_COLLATERAL_ISSUER_SECTOR (siehe Anhang I)	
S210	SPECIAL COLLATERAL INDICATOR (Kennzeichen für Special Collateral)	Zeichenkette. Länge: 4 CL_SPECIAL_COLLATERAL_INDICATOR (siehe Anhang I) Optional.	„GENE“ steht für allgemeine Sicherheiten (General Collateral). „SPEC“ steht für Special Collateral und/oder Specific Collateral. „MRRP“ steht für Matched Repo and Reverse Repo (gematchte Repos und Reverse-Repos).
S220	COLLATERAL NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Sicherheit)	Numerisch. Maximale Gesamtlänge: 18 Positive Zahl. Dieser Block wird mehrfach verwendet, wenn es mehrere Sicherheiten gibt. Dezimalstellen: bis zu 5 Währung [ISO 4127]	1000000 EUR, wobei „EUR“ für Euro steht. Die gemeldete Währung muss stets Euro sein.
S230	COLLATERAL HAIRCUT (Sicherheitsabschlag)	Numerisch. Maximale Gesamtlänge: 11 Positive oder negative Zahl. Dezimalstellen: bis zu 10 Einheit: Prozentpunkte	„10.234“ steht für einen Collateral Haircut (Sicherheitsabschlag) von 10,234 %.

Zusätzlich zu den in der vorstehenden Tabelle mit den Felddefinitionen zur Verfügung gestellten Informationen gelten die folgenden allgemeinen Regeln für die Meldung von ganzen Zahlen und Dezimalstellen für numerische Variablen:

- Ganze Zahlen müssen immer mit exakter Genauigkeit gemeldet und dürfen nicht gerundet werden.

Beispiel: Tatsächlicher Collateral Nominal Amount (Nennwert der Sicherheit) = 12.000.500

Korrekte Meldung: Collateral Nominal Amount = 12.000.500

Fehlerhafte Meldung: Collateral Nominal Amount = 12.000.000

- Dezimalstellen müssen entsprechend der Felddefinitionen gemeldet werden; ferner muss die maximal zur Verfügung stehende Anzahl von Dezimalstellen angegeben werden.

Beispiel: Tatsächliche Deal Rate (Zinssatz der Transaktion) = 1,1222335874

Korrekte Meldung: Deal Rate = 1.1222335874

Fehlerhafte Meldung: Deal Rate = 1.12

## 4. Konzeptionelle und Felddefinitionen für das unbesicherte Marktsegment

### 4.1 Referenztable zu meldepflichtigen Instrumenten im unbesicherten Marktsegment

Im Bereich des unbesicherten Geldmarktes hat eine Meldung von Transaktionen an die Deutsche Bundesbank zu erfolgen, die folgende Geschäftsarten beinhaltet:

- Geldaufnahmen über unbesicherte auf Euro lautende Einlagen und Tagesgeldkonten (mit Ausnahme von Girokonten), wie in der nachstehenden Tabelle definiert, mit einem Nennwert von mindestens 500.000 EUR und einer Laufzeit von bis zu und einschließlich einem Jahr (definiert als Transaktionen mit einer Laufzeit von nicht mehr als 397 Tagen nach dem Abwicklungstag) des Berichtspflichtigen von finanziellen Kapitalgesellschaften (Ausnahme von Zentralbanken, sofern die Transaktion nicht zu Investitionszwecken dient), dem Staat sowie nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, die nach dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk als „Großkunden“ klassifiziert sind;
- Geldvergaben über unbesicherte auf Euro lautende Einlagen und Tagesgeldkonten (mit Ausnahme von Girokonten), wie in der nachstehenden Tabelle definiert, mit einem Nennwert von mindestens 500.000 EUR und einer Laufzeit von bis zu und einschließlich einem Jahr (definiert als Transaktionen mit einer Laufzeit von nicht mehr als 397 Tagen nach dem Abwicklungstag) des Berichtspflichtigen an andere Kreditinstitute.

Die nachstehende Tabelle enthält eine ausführliche Standardbeschreibung von unbesicherten Einlagen und Tagesgeldkonten:

Bezeichnung der Einlage	Beschreibung
Einlage (Deposit)	Unbesicherte verzinsliche Einlagen mit vereinbarter Kündigungsfrist oder einer Laufzeit von nicht mehr als einem Jahr, d. h. bis zu 397 Tagen nach dem Abwicklungstag, die entweder vom Berichtspflichtigen hereingenommen (Geldaufnahme) oder platziert (Geldvergabe) werden.
Tagesgeldkonto/Sparkonto (Call Account/Call Money)	Barkonten mit täglich wechselndem Zinssatz, für die in regelmäßigen Zeitabständen Zinsen gezahlt oder berechnet werden und bei denen Geldabhebungen einer Kündigungsfrist unterliegen.  Sparkonten, bei denen Geldabhebungen einer Kündigungsfrist unterliegen.

- Geldaufnahmen über die Emission von auf Euro lautenden kurzfristigen Wertpapieren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, mit einer Laufzeit von bis zu und einschließlich einem Jahr (definiert als Transaktionen mit einer Laufzeit von nicht mehr als 397 Tagen nach dem Abwicklungstag) durch den Berichtspflichtigen von finanziellen Kapitalgesellschaften (mit Ausnahme von Zentralbanken, sofern die Transaktion nicht zu Investitionszwecken dient), dem Staat sowie nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, die nach dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk als „Großkunden“ klassifiziert sind;
- Geldvergaben über den Kauf auf dem Primärmarkt von auf Euro lautenden kurzfristigen Wertpapieren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, mit einer Laufzeit von bis zu und einschließlich einem Jahr (definiert als Transaktionen mit einer Laufzeit von nicht mehr als 397 Tagen nach dem Abwicklungstag), die von anderen Kreditinstituten ausgegeben werden.

Die nachstehende Tabelle enthält eine ausführliche Standardbeschreibung von kurzfristigen Wertpapieren:

<b>Bezeichnung des kurzfristigen Wertpapiers</b>	<b>Beschreibung</b>
Einlagenzertifikat (Certificate of Deposit)	Ein von einem MFI ausgegebener unbesicherter Schuldtitel in übertragbarer oder nicht übertragbarer Form mit fester Laufzeit, der den Inhaber für einen festgelegten Zeitraum von bis zu einem Jahr, d. h. bis zu 397 Tagen nach dem Abwicklungstag, zu einem bestimmten Festzins berechtigt, der entweder verzinslich oder diskontiert ist
Commercial Paper	Ein von einem MFI ausgegebener unbesicherter Schuldtitel, der eine Laufzeit von nicht mehr als einem Jahr, d. h. bis zu 397 Tagen nach dem Abwicklungstag, hat und entweder verzinslich oder diskontiert ist.
Asset Backed Commercial Paper	Ein von einem MFI ausgegebener Schuldtitel, der eine Laufzeit von nicht mehr als einem Jahr, d. h. bis zu 397 Tagen nach dem Abwicklungstag, hat und entweder verzinslich oder diskontiert ist und durch Sicherheiten (irgendeiner Art) besichert wird.
Variabel verzinsliche Schuldverschreibung (Floating Rate Note – FRN)	Ein Schuldtitel, bei dem die periodischen Zinszahlungen auf Grundlage des Wertes (sogenanntes Fixing) eines zugrunde liegenden Referenzzinssatzes wie z.B. des EURIBORs zu im Voraus festgelegten Tagen (den sogenannten Fixing-Terminen) berechnet werden und der eine Laufzeit von nicht mehr als einem Jahr, d. h. bis zu 397 Tagen nach dem Abwicklungstag, hat.
Sonstige kurzfristige Schuldverschreibungen (Other Short-term Debt Securities Issued)	Nichtnachrangige Schuldverschreibungen außer sonstigen Anteilsrechten mit einer Laufzeit von bis zu einem Jahr, d. h. bis zu 397 Tagen nach dem Abwicklungstag; dabei handelt es sich um Finanzinstrumente, die in der Regel handelbar sind und an Sekundärmärkten gehandelt werden oder am Markt verrechnet werden können, dem Inhaber aber keine Eigentumsrechte am Emissionsinstitut einräumen. Hierunter fallen:

	<p>a) Wertpapiere, die dem Inhaber ein uneingeschränktes Recht auf ein festes oder vertraglich vereinbartes Einkommen in Form von Kuponzahlungen und/oder einem angegebenen festen Betrag zu einem bestimmten Tag (oder bestimmten Tagen) oder ab einem zum Zeitpunkt der Emission festgelegten Tag einräumen;</p> <p>b) nicht börsenfähige Instrumente, die zu einem späteren Zeitpunkt börsenfähig werden und als „Schuldverschreibungen“ reklassifiziert werden sollten.</p>
--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 4.2 Meldung von Tagesgeldkonten und Sparkonten

Tagesgeldkonten und Sparkonten sind bis zu ihrer Kündigung durchgehend täglich als neue Transaktion zu melden, mit einem neuen Meldesatz pro Geschäftstag.<sup>28</sup> Nur Sparkonten mit Kündigungsfrist<sup>29</sup> sind zu melden.

Eine Meldung von Tagesgeld- und Sparkonten hat bis zur Kündigung des Kontos zu erfolgen. Die Beendigung selbst unterliegt nicht der Meldepflicht. Tagesgeld- und Sparkonten, die vor dem 1. Juli 2024 eröffnet wurden, noch bestehen und noch nicht gekündigt wurden, müssen ebenfalls gemeldet werden. Diesbezüglich stellt der Tag der ursprünglichen Eröffnung des Kontos kein Kriterium für die Meldepflicht dar.

Es sind täglich sämtliche Bestände der Tagesgeld- oder Sparkonten zu melden und entsprechend als neue Transaktion (mit dem Kennzeichen „NEWT“ und einer neuen PTI) zu übermitteln. Ein Tagesgeld- oder Sparkonto ist auch dann täglich als neue Transaktion zu melden, wenn sich die Bestände des Tagesgeld- oder Sparkontos nicht verändern. Es ist lediglich der ausstehende Betrag des Tagesgeld- oder Sparkontos am Ende des Geschäftstags zu melden, nicht jedoch die einzelnen im Laufe des Handelstags eintretenden Veränderungen. Kommt es zu einer Änderung einer der sonstigen Variablen der Transaktion (im Vergleich zur vorherigen Meldung), muss diese Änderung entsprechend in der neu gemeldeten Transaktion mit dem Tagesgeld- oder Sparkonto berücksichtigt werden.

Sobald ein Tagesgeld- oder Sparkonto gekündigt wird, endet die tägliche Meldung. Der letzte Meldesatz für das Tagesgeld- oder Sparkonto wird mit dem Handels- und Abwicklungstag übermittelt, der dem Tag entspricht, an dem das Konto gekündigt oder die Kündigung ausgesprochen wird.

Grundsätzlich sind Transaktionen mit Tagesgeldkonten mit Overnight-Fälligkeit zu melden. Weist das Tagesgeldkonto eine längere Kündigungsfrist als Overnight-Fälligkeit auf, muss die Laufzeit die Kündigungsfrist widerspiegeln.

Sämtliche Transaktionen mit Sparkonten müssen mit einer Laufzeit gemeldet werden, die die Kündigungsfrist widerspiegelt.

<sup>28</sup> Die durchgehende tägliche Meldung von Tagesgeldkonten und Sparkonten (und anderen ähnlichen unbesicherten Transaktionen wie Einlagen ohne feste Laufzeit und mit Kündigungsfrist) hat analog zu den in Kapitel 3.2 für die Meldung von kündbaren und Evergreen-Repos mit oder ohne feste Laufzeit vorgesehenen Regeln zu erfolgen.

<sup>29</sup> Die Kündigungsfrist ist eine vom Kunden einzuhaltende Frist, bevor die Verfügung über den gekündigten Betrag möglich ist. Nach dieser Frist kann das Konto geschlossen werden oder bestehen bleiben.

Die Felder „Call or Put“ (Kauf- oder Verkaufsoption) und „First Call/Put Date“ (Erster Kauf-/Verkaufstag) sind für Tagesgeldkonten nicht zu melden.

Beispiel: Meldung von Tagesgeldkonten mit einer Kündigungsfrist von 1 Tag:

Tag	Transaktion	Nennwert	PTI
T	Neues Tagesgeldkonto	100.000	„1“
T+1	Keine Änderung, d. h. Rollover	100.000	„2“
T+2	Rollover und zusätzl. Erhöhung des Volumens um 50.000	150.000	„3“
T+3	Rückzahlung von 120.000	30.000	„4“
T+4	Konto wird gekündigt und Betrag wird am nächsten Tag ausgezahlt.	30.000	„5“
T+5	Kündigung des Tagesgeldkontos	Keine Meldung	–

Nur Sparkonten mit Kündigungsfrist sind zu melden. Sparkonten ohne Kündigungsfrist gelten als Girokonten und sind somit im Rahmen der Geldmarktstatistik nicht meldepflichtig. Die Laufzeit einer gemeldeten Transaktion mit einem Sparkonto muss die Kündigungsfrist widerspiegeln – z. B. muss im Fall einer Kündigungsfrist von 30 Tagen eine Fälligkeit von Abwicklungstag + 30 Tage gemeldet werden.

Darüber hinaus ist jede Änderung am Nennwert des Kontos zu melden – d. h. in dem Beispiel ist die Erhöhung des Kontostands zwischen dem Abwicklungstag und dem Fälligkeitstag zu melden, und zwar an dem Tag, an dem sie erfolgt.

Der gemeldete Zinssatz muss den an dem jeweiligen Tag auf das Konto anwendbaren Zinssatz widerspiegeln. Dabei ist der neue Zinssatz zu melden, sobald er anwendbar wird; dies gilt unabhängig von dem Zeitraum, in dem dies stattfindet.

Im Fall eines Geschäfts mit einem variablen Zinssatz ist als Rate Type (Art des Zinssatzes) „VARI“ zu verwenden und anschließend der REFERENCE RATE INDEX (Referenzzinssatz) im Block „FloatingRateNote“ der MMSR message zu melden.

Beispiel: Meldung von Sparkonten mit einer Kündigungsfrist von 3 Tagen:

Tag	Transaktion	Betrag	PTI
T	Neues Sparkonto	100.000	„1“
T+1	Keine Änderung, d. h. Rollover	100.000	„2“
T+2	Rollover und zusätzl. Erhöhung des Volumens um 50.000	150.000	„3“

Tag	Transaktion	Betrag	PTI
T+3	Rückzahlung von 120.000	30.000	„4“
T+4	Konto wird gekündigt/ausgezahlt	30.000	„5“
T+5	Keine Meldung		
T+6	Keine Meldung		
T+7	Kündigung des Kontos	Keine Meldung	–

### 4.3 Primärmarkt

Primärmarkttransaktionen sind als Transaktionen mit Wertpapieren definiert, die bei ihrer Emission (am Emissionstag) unmittelbar vom Emittenten gekauft werden. Typischerweise betragen die aufgelaufenen Zinsen bei solchen Geschäften null. Der Käufer kauft entweder unmittelbar von dem Emittenten oder von einem Händler (Dealer), der das Wertpapier, z. B. Commercial Paper, vertreibt. Hauptkriterium für die Identifizierung des Primärmarkts ist nicht nur die Gegenpartei (die auf dem Primärmarkt mit dem Emittenten identisch ist), sondern das Fehlen von aufgelaufenen Zinsen am Abwicklungstag des Kaufs.

Folgende zwei Formen von Primärmarkttransaktionen sind zu melden:

- (a) Die **Emission** von kurzfristigen Wertpapieren, d. h. **Geldaufnahme**. Ausgenommen sind der Rück- und Wiederverkauf der Wertpapiere, da es sich bei diesen Transaktionen um Sekundärmarktgeschäfte handelt;
- (b) Der **Kauf** von (von einer Gegenpartei ausgegebenen) kurzfristigen Wertpapieren auf dem **Primärmarkt**, d. h. **Geldvergabe**. Ausgenommen ist der Kauf von einem Dritten, da es sich bei dieser Transaktion um ein Sekundärmarktgeschäft handelt.

Geschäfte auf dem grauen Markt (Handel mit dem gerade ausgegebenen Wertpapier zwischen Händlern und nicht zwischen Händlern und dem Emittenten vor Abwicklung der Emission) sind nicht meldepflichtig, da nur die von dem Emittenten aufgenommenen oder von dem/den Käufer(n) unmittelbar an den Emittenten verliehenen Gelder zu melden sind.

### 4.4 Erläuterungen der zu meldenden Variablen im unbesicherten Segment

Die für unbesicherte, auf Euro lautende Transaktionen zu meldenden Variablen sind in der nachfolgenden Tabelle aufgeführt. Nicht alle Variablen und Elemente, die im XML-Schema nach ISO20022 für das unbesicherte Marktsegment enthalten sind, finden derzeit in der Geldmarktstatistik Anwendung. Insbesondere die Variablen BRANCH IDENTIFICATION und BROKERED DEAL sowie der Block „NameAndLocation“, der Teil des Blocks „CounterpartyIdentification“ der Meldung ist, werden aktuell nicht für die Geldmarktstatistik genutzt und demzufolge nicht in der folgenden Tabelle aufgeführt.

Name der Variablen	Beschreibung
REPORTED TRANSACTION STATUS (Transaktionsstatus)	Diese Variable enthält Informationen über den Status der Transaktion, d. h. darüber, ob es sich um eine neue Transaktion, ein Amendement einer früher gemeldeten Transaktion, eine Cancellation einer früher gemeldeten Transaktion oder eine Correction einer bereits gemeldeten und abgewiesenen Transaktion handelt.
NOVATION STATUS (Novationsstatus)	Diese Variable spezifiziert, ob es sich bei der Transaktion um eine Novation handelt, d. h. um eine Transaktion, bei der u. a. die Gegenpartei geändert wurde. Änderungen der Gegenpartei aufgrund von Geschäftsvorfällen (wie z. B. Fusionen) sind nicht als Novationen zu melden.  <i>Liegt eine Novation vor, ist dieses Feld ein Pflichtfeld.</i>
UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER (Eindeutige Transaktionskennung; UTI)	Diese Variable enthält die UTI, bei der es sich um eine eindeutige Kennziffer zur Identifikation einer Transaktion in dem jeweiligen Marktsegment handelt.  <i>Zu melden, sofern zum Zeitpunkt der Einreichung der Geldmarktstatistik verfügbar.</i>
PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung; PTI)	Diese Kennung ist die eindeutige interne Transaktionskennung, die der Berichtspflichtige für jede Transaktion verwendet. Die PTI, die für jede Transaktion zu übermitteln ist und mit der diese identifiziert werden kann, muss pro Marktsegment und Berichtspflichtigem einmalig sein.
RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Zugehörige Interne Transaktionskennung)	Bei dieser Variable handelt es sich um die eindeutige interne Transaktionskennung, die der Berichtspflichtige für die ursprüngliche Transaktion verwendet hat, die durch eine Novation ersetzt wurde.  <i>Liegt eine Novation vor, ist dieses Feld ein Pflichtfeld.</i>
COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung der Gegenpartei)	Diese Variable enthält die derselben Transaktion von der Gegenpartei des Berichtspflichtigen zugewiesene PTI.  <i>Bei Verfügbarkeit zu melden.</i>

Name der Variablen	Beschreibung
<p>COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei)</p>	<p>Diese Variable enthält die LEI der Gegenpartei des Berichtspflichtigen.</p> <p>Dieses Feld ist ein Pflichtfeld für alle Gegenparteien, die über eine LEI verfügen. Handelt es sich bei der Gegenpartei um eine Zweigniederlassung, ist die LEI der Muttergesellschaft, d. h. des Rechtsträgers, der die Zweigniederlassung gegründet hat und kontrolliert, zu melden. Wird die Transaktion über eine CCP (Central Clearing Counterparty) abgeschlossen, ist in diesem Feld die LEI der CCP zu melden.</p> <p>In allen anderen Fällen, z. B. wenn die Gegenpartei über keine LEI verfügt, darf diese Variable nicht im XML-Schema enthalten sein, und es sind stattdessen der COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei) und die COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei) zu melden.</p> <p>Diese Variable wird in der MMSR message als „LEI“ bezeichnet und befindet sich im Block „CounterpartyIdentification“.</p>
<p>COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei)</p>	<p>Mit dieser Variablen wird der Sektor der Gegenpartei, z. B. nichtfinanzielle Kapitalgesellschaft oder Zentralbank, angegeben.</p> <p>Der COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei) ist für alle Transaktionen zu melden, bei denen die COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei) nicht angegeben ist.</p> <p>Diese Variable wird in der MMSR message als „Sector“ bezeichnet und befindet sich im Block „SectorAndLocation“ des Blocks „CounterpartyIdentification“.</p>
<p>COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei)</p>	<p>Diese Variable beinhaltet den ISO-Ländercode des Landes, in dem die Gegenpartei ihren Sitz hat.</p> <p>Die COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei) ist für alle Transaktionen zu melden, bei denen die COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei) nicht angegeben ist.</p> <p>Diese Variable wird in der MMSR message als „Location“ bezeichnet und befindet sich im Block „SectorAndLocation“ des Blocks „CounterpartyIdentification“.</p>
<p>TRADE DATE (Handelstag)</p>	<p>Beim Handelstag handelt es sich um den Tag und die Uhrzeit, an denen die Parteien die gemeldete Transaktion vereinbart haben. Sollte die Uhrzeit der Transaktion nicht verfügbar sein, ist nur deren Datum zu melden.</p> <p>Die zu meldende Uhrzeit ist die Ausführungszeit (sofern verfügbar) oder alternativ die Zeit, zu der die Transaktion im Buchungssystem des Berichtspflichtigen erfasst</p>

Name der Variablen	Beschreibung
	<p>wird. Die Zeit ist stets als realer Zeitpunkt und nicht als Standardwert (z. B. Mitternacht) anzugeben.</p> <p>Das TRADE DATE (Handelstag) hat stets an oder vor dem SETTLEMENT DATE (Abwicklungstag) zu liegen. Ausnahmen sind lediglich bei Novationen oder in den Fällen zulässig, in denen die Gegenparteien eine vor dem TRADE DATE beginnende Verzinsung vereinbart haben. Trifft eine der beiden Ausnahmen zu, kann ein nach dem SETTLEMENT DATE liegendes TRADE DATE gemeldet werden.</p>
SETTLEMENT DATE (Abwicklungstag)	<p>Der Tag, an dem der Geldbetrag zwischen den Gegenparteien ausgetauscht wird oder an dem der Kauf- oder Verkauf von Schuldtiteln abgewickelt wird. In Bezug auf Tagesgeldkonten und andere unbesicherte Geldaufnahmen/Geldvergaben mit vereinbarter Kündigungsfrist bezeichnet die Variable den Tag, an dem die Einlagen verlängert werden, d. h. an dem diese zurückgezahlt worden wären, wenn sie abgerufen/nicht verlängert worden wären. Falls die Abwicklung aufgrund einer Abwicklungsstörung an einem anderen Tag als ursprünglich vereinbart stattfindet, ist kein Amendment der Transaktion zu melden.</p>
MATURITY DATE (Fälligkeitstag)	<p>Der Tag, an dem der Geldbetrag fällig und vom Kreditnehmer an den Kreditgeber zurückzuzahlen ist oder an dem ein Schuldtitel fällig wird und zurückzuzahlen ist. Wie bei Instrumenten mit Kündigungsfrist und mit Kündigungsrechten ist der Endfälligkeitstag zu melden.</p> <p>Tagesgeldkonten und andere unbesicherte Geldaufnahmen/Geldvergaben mit vereinbarter Kündigungsfrist sind stets mit Overnight-Fälligkeit zu melden. Für den Fall, dass bei dem Instrument keine Rückzahlung/Kündigung/Schließung mit Overnight-Fälligkeit möglich ist, muss als Fälligkeitstag der erste Tag angegeben werden, an dem die Kündigung erfolgen kann. Bei der Meldung von Sparkonten muss die Laufzeit die Länge der Kündigungsfrist widerspiegeln.</p>
INSTRUMENT TYPE (Art des Instruments)	<p>Mit dieser Variablen wird das Instrument angegeben, über das die Geldaufnahme/Geldvergabe stattfindet. Die Art des Instruments ist aus der Referenztabelle für die Arten von Instrumenten in Kapitel 4.1 auszuwählen.</p>
TRANSACTION TYPE (Art der Transaktion)	<p>Diese Variable gibt an, ob es sich bei der Transaktion um eine Geldaufnahme oder eine Geldvergabe handelt.</p>
TRANSACTION NOMINAL AMOUNT	<p>Der Nennwert der Transaktion bezeichnet den als Einlage aufgenommenen oder bereitgestellten Geldbetrag, bei Schuldverschreibungen den Nennwert des</p>

Name der Variablen	Beschreibung
(Nennwert der Transaktion)	ausgegebenen/erworbenen Wertpapiers. In der MMSR message ist zu spezifizieren, dass es sich bei der Währung um Euro handelt.
TRANSACTION DEAL PRICE (Preis der Transaktion)	Dieses Feld enthält den Preis (Dirty Price) in Prozentpunkten, zu dem das Wertpapier ausgegeben oder gehandelt wird. Bei unbesicherten Einlagen als 100 anzugeben.  Diese Variable wird in der MMSR message als „DealPrice“ bezeichnet.
RATE TYPE (Art des Zinssatzes)	Mögliche Werte: <ul style="list-style-type: none"> <li>• fester Zinssatz für Einlagen und Schuldtitel mit festem Kupon;</li> <li>• variabler Zinssatz für Schuldtitel und unbesicherte Einlagen, bei denen die Auszahlung bei Fälligkeit oder in einem bestimmten Zeitraum von dem beobachteten Wert eines zugrunde liegenden Referenzzinssatzes abhängig ist.</li> </ul>
DEAL RATE (Zinssatz der Transaktion)	Der Zinssatz gemäß der ACT/360-Geldmarktkonvention, zu dem die Einlage hinterlegt wurde und zu dem der bereitgestellte Geldbetrag vergütet wird. Bei Schuldtiteln ist dies der effektive Zinssatz gemäß der ACT/360 Geldmarktkonvention, zu dem das Instrument ausgegeben oder erworben wurde.  Der Zinssatz kann entweder positiv oder negativ sein, unabhängig davon, ob der Geldbetrag aufgenommen oder bereitgestellt wird. Er stellt den vertraglich vereinbarten Satz dar, zu dem der Nennwert der Transaktion vergütet wird, und zwar unabhängig vom Transaktionsvorzeichen (d. h. ob der TRANSACTION TYPE (Art der Transaktion) als Geldaufnahme oder Geldvergabe gemeldet wird).  <i>Dieses Feld ist nur bei Geschäften mit festverzinslichen Instrumenten zu melden.</i>
REFERENCE RATE INDEX (Referenzzinssatz)	Diese Variable beschreibt den ISIN-Code des zugrunde liegenden Referenzzinssatzes, auf dessen Grundlage die periodischen Zinszahlungen berechnet werden.  Eine vollständige Liste der ISIN-Codes für die verschiedenen REFERENCE RATE INDICES (Referenzzinssätze) findet sich in Anhang IV.  <i>Dieses Feld ist nur für variabel verzinsliche Instrumente zu melden.</i>  Diese Variable befindet sich im Block „FloatingRateNote“ der MMSR message.
BASIS POINT SPREAD (Spread in Basispunkten)	Die Anzahl der Basispunkte, die auf den zugrunde liegenden Referenzzinssatz aufgeschlagen (bei einem positiven Wert) oder von diesem abgezogen (bei einem negativen Wert) werden, um den tatsächlichen Zinssatz für einen bestimmten Zeitraum bei der Emission des variabel verzinslichen Instruments zu berechnen.

Name der Variablen	Beschreibung
	<p><i>Dieses Feld ist nur für variabel verzinsliche Instrumente zu melden.</i></p> <p>Diese Variable befindet sich im Block „FloatingRateNote“ der MMSR message.</p>
<p>CALL OR PUT (Kauf- oder Verkaufsoption)</p>	<p>Dieses Attribut gibt an, ob das Instrument eine Kauf- oder Verkaufsoption hat. Wenn ein Instrument beide Optionen umfasst, d. h. eine Kauf- und eine Verkaufsoption, sind beide Optionen zu melden.</p> <p><i>Dieses Feld ist nur bei Instrumenten mit einer Kauf- oder Verkaufsoption zu melden.</i></p> <p><i>Weist das Instrument eine Kauf- oder Verkaufsoption auf, ist mindestens eines der Felder FIRST CALL/PUT DATE (Erster Kauf-/Verkaufstag) und CALL/PUT NOTICE PERIOD (Kündigungsfrist der Kauf-/ Verkaufsoption) zu melden.</i></p> <p><i>Diese Variable ist bei Tagesgeldkonten und Sparkonten nicht zu melden.</i></p> <p>Diese Variable befindet sich im Block „CallPutOption“ der MMSR message und wird als „Type“ bezeichnet.</p>
<p>FIRST CALL/PUT DATE (Erster Kauf-/ Verkaufstag)</p>	<p>Der erste Tag, an dem die Kauf- oder Verkaufsoption ausgeübt werden darf.</p> <p><i>Die Meldung dieses Felds ist nur für Instrumente mit einer Kauf- oder Verkaufsoption erforderlich, die zu einem oder mehr feststehenden Terminen ausgeübt werden kann.</i></p> <p><i>Diese Variable ist bei Tagesgeldkonten und Sparkonten nicht zu melden.</i></p> <p>Diese Variable befindet sich im Block „CallPutOption“ der MMSR message und wird als „EarliestExerciseDate“ bezeichnet.</p>
<p>CALL/PUT NOTICE PERIOD (Kündigungsfrist der Kauf-/Verkaufsoption)</p>	<p>Die Anzahl von Kalendertagen, die der Inhaber des Instruments dem Emittenten bzw. der Emittent dem Inhaber des Instruments einräumt, bevor er die Kauf-/ Verkaufsoption ausübt.</p> <p><i>Die Meldung dieses Felds ist nur bei Instrumenten/Transaktionen mit einer Kündigungs-/Ausübungsfrist für die Kauf-/Verkaufsoption und bei Einlagen mit vereinbarter Kündigungsfrist erforderlich, d. h. bei allen Instrumenten, bei denen der Inhaber der Option den Gegenparteien eine Mindestanzahl von Tagen gewähren muss, bevor die Option ausgeübt werden kann.</i></p> <p><i>Diese Variable ist bei Tagesgeldkonten und Sparkonten nicht zu melden.</i></p> <p>Diese Variable befindet sich im Block „CallPutOption“ der MMSR message und wird als „NoticePeriod“ bezeichnet.</p>

#### 4.5 Felddefinitionen für das unbesicherte Marktsegment (Tabelle 2)

Variable	Name der Variablen	Art	Beispiel
U10	REPORTED TRANSACTION STATUS (Transaktionsstatus)	Zeichenkette. Länge: 4 CL_REPORTED_TRANSACTION_STATUS (siehe Anhang I)	
U15	NOVATION STATUS (Novationsstatus)	Zeichenkette. Länge: 4 CL_NOVATION_STATUS (siehe Anhang 1)	
U20	UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER (Eindeutige Transaktions- kennung; UTI)	Zeichenkette. Maximale Länge: 105 Eindeutige Transaktionskennung (UTI) Bis zu 105 alphanumerische Zeichen. Es sind vier Sonderzeichen zulässig: „:“, „:“, „-“, „_“ Am Anfang und am Ende sind keine Sonderzeichen zulässig. Keine Leerzeichen zulässig.	
U30	PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktions- kennung; PTI)	Zeichenkette. Maximale Länge: 105 Eindeutige Identifikationsnummer für Transaktionen je Berichtspflichtigem und Marktsegment.	
U35	RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Zugehörige interne Transaktions- kennung)	Zeichenkette. Maximale Länge: 105	
U40	COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne	Zeichenkette. Maximale Länge: 105	

Variable	Name der Variablen	Art	Beispiel
	Transaktions- kennung der Gegenpartei)		
U50	COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei)	Zeichenkette. Länge: 20 Der <b>Legal Entity Identifier (LEI; Rechtsträgerkennung)</b> ist ein 20-stelliger alphanumerischer Code, der mit wichtigen Referenzinformationen verknüpft ist und eine klare und eindeutige Identifizierung von Unternehmen ermöglicht, die an den globalen Finanzmärkten agieren. [ISO 17442]	„QS3ZEAHRBZY9228Z0111“ ist die LEI der Commerzbank International S.A.
U60	COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei)	Zeichenkette. Maximale Länge: 4 Bezieht sich auf die institutionellen Sektoren nach ESVG 2010 <sup>30</sup> CL_COUNTERPARTY_SECTOR (siehe Anhang I)	„S11“ steht für „Nichtfinanzielle Kapitalgesellschaft“.
U70	COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei)	Zeichenkette. Länge: 2 [ISO 3166-1 Alpha-2] CL_COUNTRY (siehe Anhang I)	„DE“ steht für Deutschland.
U80	TRADE DATE (Handelstag)	Tag und Uhrzeit [ISO 8601] YYYY-MM-DDThh:mm:ss+/-hh:mm <i>oder</i> YYYY-MM-DDThh:mm:ss.sss+/-hh:mm Die Angabe der Zeitzone („+/-hh:mm“) muss stets enthalten sein. Lokale Zeitformate (d. h. ohne „+/-hh:mm“) sind nicht zulässig; <i>oder</i> Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD	„2014-11-26T09:00:00+00:00“ steht für den 26. November 2014, 9:00 Uhr lokaler Zeit (GMT). <i>oder</i> „2014-11-26“ steht für den 26. November 2014 (MEZ).

<sup>30</sup> Die vollständige Liste der institutionellen Sektoren nach ESVG 2010 kann im Eurostat-Bereich der Website der Europäischen Kommission unter „www.europa.eu“ abgerufen werden.

Variable	Name der Variablen	Art	Beispiel
		Das Datum muss stets der MEZ-Zeitzone entsprechen.	
U90	SETTLEMENT DATE (Abwicklungstag)	Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD Das Datum muss stets der MEZ-Zeitzone entsprechen.	„2014-11-26“ steht für den 26. November 2014 (MEZ).
U100	MATURITY DATE (Fälligkeitstag)	Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD Das Datum muss stets der MEZ-Zeitzone entsprechen.	„2014-11-26“ steht für den 26. November 2014 (MEZ).
U110	INSTRUMENT TYPE (Art des Instruments)	Zeichenkette. Länge: 4 CL_INSTRUMENT_TYPE (siehe Anhang I)	„DPST“ steht für Einlage.
U120	TRANSACTION TYPE (Art der Transaktion)	Zeichenkette. Länge: 4 CL_TRANSACTION_TYPE (siehe Anhang I)	„BORR“ steht für Geldaufnahme. „LEND“ steht für Geldvergabe.
U130	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Transaktion)	Numerisch. Maximale Gesamtlänge: 18 Positive Zahl Dezimalstellen: bis zu 5 Währung [ISO 4127]	1000000 EUR, wobei „EUR“ für Euro steht. Die gemeldete Währung muss stets Euro sein.
U140	TRANSACTION DEAL PRICE (Preis der Transaktion)	Numerisch. Maximale Gesamtlänge: 11 Dezimalstellen: bis zu 10 Einheit: Prozentpunkte	„99.234“ steht für den Transaction Deal Price (Preis der Transaktion) von 99,234 %.
U150	RATE TYPE (Art des Zinssatzes)	Zeichenkette. Länge: 4 CL_RATE_TYPE (siehe Anhang I)	„VARI“ steht für einen variablen Zinssatz.
U160	DEAL RATE (Zinssatz der Transaktion)	Numerisch. Maximale Gesamtlänge: 11 Positive oder negative Zahl Dezimalstellen: bis zu 10 Einheit: Prozentpunkte	„10.234“ steht für einen Zinssatz der Transaktion von 10,234 %.

Variable	Name der Variablen	Art	Beispiel
U170	REFERENCE RATE INDEX (Referenzzinssatz)	Zeichenkette. Länge: 12 ISIN des Basiswerts [ISO 6166]	„EU0009652783“ steht für den 3-Monats-EURIBOR.
U180	BASIS POINT SPREAD (Spread in Basispunkten)	Numerisch. Maximale Gesamtlänge: 18 Positive oder negative Zahl Dezimalstellen: 0 Einheit: Basispunkte	1023 steht für einen Spread von 10,234 %. Da die Einheit Basispunkte ist, werden die 10,234 % hier zunächst auf 10,23 % gerundet und dann in 1023 umgewandelt.
U190	CALL OR PUT (Kauf- oder Verkaufsoption)	Zeichenkette. Länge: 4 CL_CALL_PUT (siehe Anhang I)	„CALL“ steht für Kaufoption.
U200	FIRST CALL/PUT DATE (Erster Kauf-/ Verkaufstag)	Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD Das Datum muss stets der MEZ-Zeitzone entsprechen.	„2014-11-26“ steht für den 26. November 2014 (MEZ).
U210	CALL/PUT NOTICE PERIOD (Kündigungsfrist der Kauf-/ Verkaufsoption)	Numerisch. Maximale Gesamtlänge: 18 Dezimalstellen: 0	„7“ steht für eine Kündigungsfrist von einer Woche.

Zusätzlich zu den in der vorstehenden Tabelle mit den Felddefinitionen zur Verfügung gestellten Informationen gelten die folgenden allgemeinen Regeln für die Meldung von ganzen Zahlen und Dezimalstellen für numerische Variablen:

- Ganze Zahlen müssen immer mit exakter Genauigkeit gemeldet und dürfen nicht gerundet werden.  
Beispiel: Tatsächlicher Transaction Nominal Amount (Nennwert der Transaktion) = 10.500.000  
Korrekte Meldung: Transaction Nominal Amount = 10500000  
Fehlerhafte Meldung: Transaction Nominal Amount = 10000000
- Dezimalstellen müssen entsprechend der Felddefinitionen gemeldet werden, und es muss die maximal zur Verfügung stehende Anzahl von Dezimalstellen angegeben werden.  
Beispiel: Tatsächlicher Deal Price (Preis der Transaktion) = 13,258632255

Korrekte Meldung: 13.258632255

Fehlerhafte Meldung: 13.2586

## 5. Konzeptionelle und Felddefinitionen für Devisenswapgeschäfte

### 5.1 Konzeptionelle Definitionen

Die Meldung zur Geldmarktstatistik erfolgt durch die Berichtspflichtigen an die Deutsche Bundesbank. Zu melden sind alle Devisenswapgeschäfte mit einer Laufzeit von bis zu und einschließlich einem Jahr (definiert als Transaktionen mit einer Laufzeit von nicht mehr als 397 Tagen nach dem Abwicklungstag), bei denen am Kassamarkt Euro gegen eine Fremdwährung mit einem Nennwert von mindestens 500.000 EUR gekauft bzw. verkauft werden und die von dem Berichtspflichtigen mit finanziellen Kapitalgesellschaften (mit Ausnahme von Zentralbanken, wenn die Transaktion mit geldpolitischen Operationen des Eurosystems im Zusammenhang steht), dem Staat sowie mit nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, die nach dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk als „Großkunden“ klassifiziert sind, durchgeführt werden.

Die für jede Transaktion mit dem Devisenswapgeschäft zu meldenden Variablen sind in der folgenden Tabelle aufgeführt.<sup>31</sup> Nicht alle Variablen und Elemente, die im XML-Schema nach ISO20022 für das Segment Devisenswapgeschäfte enthalten sind, finden derzeit in der Geldmarktstatistik Anwendung. Insbesondere die Variablen BRANCH IDENTIFICATION und der Block „NameAndLocation“, der Teil des Blocks „CounterpartyIdentification“ der Meldung ist, werden aktuell nicht für die Geldmarktstatistik genutzt und demzufolge nicht in der folgenden Tabelle aufgeführt.

Name der Variablen	Beschreibung
REPORTED TRANSACTION STATUS (Transaktionsstatus)	Diese Variable enthält Informationen über den Status der Transaktion, d. h. darüber, ob es sich um eine neue Transaktion, ein Amendment einer früher gemeldeten Transaktion, eine Cancellation einer früher gemeldeten Transaktion oder eine Correction einer bereits gemeldeten und abgewiesenen Transaktion handelt.
NOVATION STATUS (Novationsstatus)	Diese Variable spezifiziert, ob es sich bei der Transaktion um eine Novation handelt, d. h. um eine Transaktion, bei der u. a. die Gegenpartei geändert wurde. Änderungen der Gegenpartei aufgrund von Geschäftsvorfällen (wie z. B. Fusionen) sind nicht als Novationen zu melden.  <i>Liegt eine Novation vor, ist dieses Feld ein Pflichtfeld.</i>

<sup>31</sup> Der Kauf oder Verkauf von Euro gegen Fremdwährung, der zu einem kurzfristigen Valutatag mit der vertraglichen Verpflichtung abgewickelt wird, die gekaufte Fremdwährung an einem im Voraus vereinbarten zukünftigen Valutatag wieder zu verkaufen, ist als Devisenswapgeschäft zu melden.

Name der Variablen	Beschreibung
UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER (Eindeutige Transaktionskennung; UTI)	<p>Diese Variable enthält die UTI, bei der es sich um eine eindeutige Kennziffer zur Identifikation einer Transaktion in dem jeweiligen Marktsegment handelt.</p> <p><i>Zu melden, sofern zum Zeitpunkt der Einreichung der Geldmarktstatistik verfügbar.</i></p>
PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung; PTI)	<p>Diese Kennung ist die eindeutige interne Transaktionskennung, die der Berichtspflichtige für jede Transaktion verwendet. Die PTI, die für jede Transaktion zu übermitteln ist und mit der diese identifiziert werden kann, muss pro Marktsegment und Berichtspflichtigem einmalig sein.</p>
RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Zugehörige interne Transaktionskennung)	<p>Bei dieser Variable handelt es sich um die eindeutige interne Transaktionskennung, die der Berichtspflichtige für die ursprüngliche Transaktion verwendet hat, die durch eine Novation ersetzt wurde.</p> <p><i>Liegt eine Novation vor, ist dieses Feld ein Pflichtfeld.</i></p>
COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung der Gegenpartei)	<p>Diese Variable enthält die derselben Transaktion von der Gegenpartei des Berichtspflichtigen zugewiesene PTI.</p> <p><i>Bei Verfügbarkeit zu melden.</i></p>
COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei)	<p>Diese Variable enthält die LEI der Gegenpartei des Berichtspflichtigen.</p> <p>Dieses Feld ist ein Pflichtfeld für alle Gegenparteien, die über eine LEI verfügen. Handelt es sich bei der Gegenpartei um eine Zweigniederlassung, ist die LEI der Muttergesellschaft, d. h. des Rechtsträgers, der die Zweigniederlassung gegründet hat und kontrolliert, zu melden. Wird die Transaktion über eine CCP (Central Clearing Counterparty) abgeschlossen, ist in diesem Feld die LEI der CCP zu melden.</p> <p>In allen anderen Fällen, z. B. wenn die Gegenpartei über keine LEI verfügt, darf diese Variable nicht im XML-Schema enthalten sein und es sind stattdessen der</p>

Name der Variablen	Beschreibung
	<p>COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei) und COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei) zu melden.</p> <p>Diese Variable wird in der MMSR message als „LEI“ bezeichnet und befindet sich im Block „CounterpartyIdentification“.</p>
<p>COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei)</p>	<p>Mit dieser Variablen wird der Sektor der Gegenpartei, z. B. nichtfinanzielle Kapitalgesellschaft oder Zentralbank, angegeben.</p> <p><i>Der COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei) ist für alle Transaktionen zu melden, bei denen die COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei) nicht angegeben ist.</i></p> <p>Diese Variable wird in der MMSR message als „Sector“ bezeichnet und befindet sich im Block „SectorAndLocation“ des Blocks „CounterpartyIdentification“.</p>
<p>COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei)</p>	<p>Diese Variable beinhaltet den ISO-Ländercode des Landes, in dem die Gegenpartei ihren Sitz hat.</p> <p><i>Die COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei) ist für alle Transaktionen zu melden, bei denen die COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei) nicht angegeben ist.</i></p> <p>Diese Variable wird in der MMSR message als „Location“ bezeichnet und befindet sich im Block „SectorAndLocation“ des Blocks „CounterpartyIdentification“.</p>
<p>TRADE DATE (Handelstag)</p>	<p>Beim Handelstag handelt es sich um den Tag und die Uhrzeit, an denen die Parteien die gemeldete Transaktion vereinbart haben. Sollte die Uhrzeit der Transaktion nicht verfügbar sein, ist nur deren Datum zu melden.</p> <p>Die zu meldende Uhrzeit ist die Ausführungszeit (sofern verfügbar) oder alternativ die Zeit, zu der die Transaktion im Buchungssystem des Berichtspflichtigen erfasst wird. Die Zeit ist stets als realer Zeitpunkt und nicht als Standardwert (z. B. Mitternacht) anzugeben.</p> <p>Das TRADE DATE (Handelstag) hat stets an oder vor dem VALUE DATE (Starttag) zu liegen. Ausnahmen sind lediglich bei Novationen oder in den Fällen zulässig, in denen die Gegenparteien eine vor dem TRADE DATE beginnende Berechnung der entsprechenden Rates vereinbart haben. Trifft eine der beiden Ausnahmen zu, kann ein nach dem VALUE DATE liegendes TRADE DATE gemeldet werden.</p>
<p>SPOT VALUE DATE (Valuta)</p>	<p>Der Tag, an dem eine Partei der anderen Partei einen bestimmten Betrag einer bestimmten Währung gegen Zahlung eines vereinbarten Betrags einer bestimmten</p>

Name der Variablen	Beschreibung
	anderen Wahrung auf Grundlage eines vereinbarten Devisenkurses, des sogenannten Devisenkassakurses, verauert.
MATURITY DATE (Falligkeitstag)	Der Tag, an dem das Devisenswapgeschaft auslauft und die am Valutatag verkaufte Wahrung zurckgekauft wird.
FX TRANSACTION TYPE (Art der Transaktion)	Diese Variable gibt an, ob der als Transaction Nominal Amount (Nennwert der Transaktion) ausgewiesene Eurobetrag am Valutatag gekauft oder verkauft wird.  Diese Variable wird in der MMSR message als „TransactionType“ bezeichnet.
TRANSACTION NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Transaktion)	Der Nennwert des Devisenswapgeschafs in Euro. Dabei handelt es sich um den am Valutatag gekauften/verkauften Betrag in Euro. Der gesamte Betrag ist in Euro zu melden. In der MMSR message ist anzugeben, dass es sich bei der Wahrung um Euro handelt.
FOREIGN CURRENCY CODE (ISO-Code der Fremdwahrung)	Das internationale dreistellige ISO-Krzel der im Austausch gegen Euro gekauften/verkauften Wahrung.  Diese Variable befindet sich im Block „ForeignExchange“ der MMSR message und wird als „ForeignCurrency“ bezeichnet.
FOREIGN EXCHANGE SPOT RATE (Devisenkassakurs)	Der Devisenkurs zwischen dem Euro und der auf der Kassaseite (first leg) des Devisenswapgeschafs anzuwendenden Fremdwahrung. Der Devisenkassakurs ist als Anzahl der Einheiten der Fremdwahrung je 1 EUR zu melden; dies gilt unabhangig von der vorherrschenden Marktkonvention fr das betreffende Wahrungspaar.  Diese Variable befindet sich im Block „ForeignExchange“ der MMSR message und wird als „ExchangeSpotRate“ bezeichnet.
FOREIGN EXCHANGE FORWARD POINTS (Swap-Punkte)	Die Differenz zwischen dem Termin- und dem Kassakurs der Devisen, ausgedrckt in Basispunkten. Die anwendbare Formel fr die Berechnung der Swap-Punkte bei Devisentermingeschaften lautet:  [[Devisenterminkurs – Devisenkassakurs) * 10.000]  Der Multiplikator kann in Abhangigkeit von der vorherrschenden Marktkonvention fr das betreffende Wahrungspaar auch andere Werte annehmen.  Eine vollstandige Liste der anwendbaren Multiplikatoren je Wahrung findet sich in Anhang VI.  Der Wert kann positiv oder negativ sein.

Name der Variablen	Beschreibung
	Diese Variable befindet sich im Block „ForeignExchange“ der MMSR message und wird als „ExchangeForwardPoint“ bezeichnet.

## 5.2 Felddefinitionen für Daten zu Devisenswapgeschäften (Tabelle 3)

Variable	Name der Variablen	Art	Beispiel
F10	REPORTED TRANSACTION STATUS (Transaktionsstatus)	Zeichenkette. Länge: 4 CL_REPORTED_TRANSACTION_STATUS (siehe Anhang I)	
F15	NOVATION STATUS (Novationsstatus)	Zeichenkette. Länge: 4 CL_NOVATION_STATUS (siehe Anhang 1)	
F20	UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER (Eindeutige Transaktionskennung; UTI)	Zeichenkette. Maximale Länge: 105 Eindeutige Transaktionskennung (UTI) Bis zu 105 alphanumerische Zeichen Es sind vier Sonderzeichen zulässig: „.“, „.“, „-“, „_“ Am Anfang und am Ende sind keine Sonderzeichen zulässig. Keine Leerzeichen zulässig	
F30	PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung; PTI)	Zeichenkette. Maximale Länge: 105 Eindeutige Identifikationsnummer für Transaktionen je Berichtspflichtigem und Marktsegment.	
F35	RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Zugehörige interne Transaktionskennung)	Zeichenkette. Maximale Länge: 105	

Variable	Name der Variablen	Art	Beispiel
F40	COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung der Gegenpartei)	Zeichenkette. Maximale Länge: 105	
F50	COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei)	Zeichenkette. Länge: 20 Die LEI ist ein 20-stelliger alphanumerischer Code, der mit wichtigen Referenzinformationen verknüpft ist und eine klare und eindeutige Identifizierung von Unternehmen ermöglicht, die an den globalen Finanzmärkten agieren. [ISO 17442]	„QS3ZEAHRBZY9228 Z0111“ ist die LEI der Commerzbank International S.A.
F60	COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei)	Zeichenkette. Maximale Länge: 4 Bezieht sich auf die institutionellen Sektoren nach ESVG 2010 <sup>32</sup> . CL_COUNTERPARTY_SECTOR (siehe Anhang I)	„S11“ steht für „Nichtfinanzielle Kapitalgesellschaft“.
F70	COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei)	Zeichenkette. Länge: 2 [ISO 3166-1 Alpha-2] CL_COUNTRY (siehe Anhang I)	„DE“ steht für Deutschland.
F80	TRADE DATE (Handelstag)	Tag und Uhrzeit [ISO 8601] YYYY-MM-DDThh:mm:ss+/-hh:mm <i>oder</i> YYYY-MM-DDThh:mm:ss.sss+/-hh:mm Die Angabe der Zeitzone („+/-hh:mm“) muss stets enthalten sein. Lokale Zeitformate (d. h. ohne „+/-hh:mm“) sind nicht zulässig <i>oder</i>	„2014-11-26T09:00:00+00:00“ steht für den 26. November 2014, 9:00 Uhr lokaler Zeit (GMT). <i>oder</i>

<sup>32</sup> Die vollständige Liste der institutionellen Sektoren nach ESVG 2010 kann im Eurostat-Bereich der Website der Europäischen Kommission unter „www.europa.eu“ abgerufen werden.

Variable	Name der Variablen	Art	Beispiel
		Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD Das Datum muss stets der MEZ-Zeitzone entsprechen.	„2014-11-26“ steht für den 26. November 2014 (MEZ).
F90	SPOT VALUE DATE (Valuta)	Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD Das Datum muss stets der MEZ-Zeitzone entsprechen.	„2014-11-26“ steht für den 26. November 2014 (MEZ).
F100	MATURITY DATE (Fälligkeitstag)	Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD Das Datum muss stets der MEZ-Zeitzone entsprechen.	„2014-11-26“ steht für den 26. November 2014 (MEZ).
F110	FX TRANSACTION TYPE (Art der Transaktion)	Zeichenkette. Länge: 4 CL_FX_TRANSACTION_TYPE (siehe Anhang I)	„BUYI“ steht für am Valutatag gekaufte Euros.
F120	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Transaktion)	Numerisch. Maximale Gesamtlänge: 18 Positive Zahl Dezimalstellen: bis zu 5 Währung [ISO 4127]	1000000 EUR, wobei „EUR“ für Euro steht. Die gemeldete Währung muss stets Euro sein.
F130	FOREIGN CURRENCY CODE (ISO-Code der Fremdwährung)	Zeichenkette. Länge: 3 [ISO 4217] CL_FCC (siehe Anhang I)	„USD“ steht für Dollar der Vereinigten Staaten.
F140	FOREIGN EXCHANGE SPOT RATE (Devisenkassakurs)	Numerisch. Maximale Gesamtlänge: 11 Dezimalstellen: bis zu 10	„1.2431“ steht für einen Devisenkassakurs von 1,2431 USD je 1 EUR <i>oder</i> „0.778743“ steht für einen

Variable	Name der Variablen	Art	Beispiel
			Devisenkassakurs von 0,778743 GBP je 1 EUR (wohingegen die vorherrschende Marktkonvention einen Devisenkassakurs von 1,28412 implizieren würde).
F150	FOREIGN EXCHANGE FORWARD POINTS (Swap-Punkte)	Numerisch. Maximale Gesamtlänge: 18 Positive oder negative Zahl Dezimalstellen: bis zu 17 (siehe Anhang VI)	„-10“ steht für 10 Swap-Punkte, die aus der Differenz zwischen einem Devisenkassakurs von 1,2431 USD je 1 EUR und einem Devisenterminkurs von 1,2421 USD je 1 EUR mal 10000 resultieren <i>oder</i> „0.27“ steht für 27 Swap-Punkte, die aus der Differenz zwischen einem Devisenkassakurs von 118,55 JPY je 1 EUR und einem Devisenterminkurs von 118,5527 JPY je 1 EUR mal 100 resultieren.

Zusätzlich zu den in der vorstehenden Tabelle mit den Felddefinitionen zur Verfügung gestellten Informationen gelten die folgenden allgemeinen Regeln für die Meldung von ganzen Zahlen und Dezimalstellen für numerische Variablen:

- Ganze Zahlen müssen immer mit exakter Genauigkeit gemeldet und dürfen nicht gerundet werden.

Beispiel: Tatsächlicher Swap-Punkt bei Devisentermingeschäft = 243

Korrekte Meldung: Swap-Punkt bei Devisentermingeschäft = 243

Fehlerhafte Meldung: Swap-Punkt bei Devisentermingeschäft = 240

- Dezimalstellen müssen entsprechend der Felddefinitionen gemeldet werden, und es muss die maximal zur Verfügung stehende Anzahl von Dezimalstellen angegeben werden.

Beispiel: Tatsächlicher Kassakurs = 1,0671256879

Korrekte Meldung: Kassakurs = 1.0671256879

Fehlerhafte Meldung: Kassakurs = 1.0671

## 6. Konzeptionelle und Felddefinitionen für Overnight Index Swaps (Tagesgeldsatz-Swapgeschäfte)

### 6.1 Konzeptionelle Definitionen

Die Meldung zur Geldmarktstatistik erfolgt durch die Berichtspflichtigen an die Deutsche Bundesbank, um die täglichen auf Euro lautenden Overnight Index Swaps (OIS) mit einem Nennbetrag von mindestens 500.000 EUR, die mit finanziellen Kapitalgesellschaften (mit Ausnahme von Zentralbanken, sofern die Transaktion nicht zu Investitionszwecken dient), dem Staat oder mit nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, die gemäß dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk als „Großkunden“ gelten, getätigt werden, zu melden. Die OIS-Geschäfte umfassen Zinsswaps, deren periodisch variabler Zinssatz dem geometrischen Mittel eines Übernacht-Zinssatzes (oder eines Übernacht-Referenzsatzes), in der Regel der Euro Short-Term Rate (€STR), über einen bestimmten Zeitraum entspricht. Die finale Zahlung berechnet sich aus der Differenz zwischen dem festen Zinssatz und dem zusammengesetzten, für die Laufzeit des OIS aufgezeichneten Übernacht-Zinssatzes, der auf den Nennbetrag des Geschäfts angewendet wird. Zinsswaps, bei denen ein fixer Zinssatz gegen „einen variablen Übernacht-Zinssatz (€STR) + einen Spread“ getauscht wird, sind nicht zu melden.

Die Meldepflicht gilt auch für Transaktionen aus dem Client Clearing, da aufgrund der Art des zentralen Clearings der Clearing Member in zwei verschiedenen Transaktionen als Principal auftritt, d. h. in der Transaktion mit der CCP und der Transaktion mit dem Kunden. Daher sind sowohl die Transaktion mit der CCP als auch die Transaktion mit dem Kunden zu melden.

Die für jede auf Euro lautende Transaktion am OIS-Markt zu meldenden Variablen sind in der folgenden Tabelle aufgeführt. Nicht alle Variablen und Elemente, die im XML-Schema nach ISO 20022 für das OIS-Segment enthalten sind, finden derzeit in der Geldmarktstatistik Anwendung. Insbesondere die Variablen BRANCH IDENTIFICATION und der Block „NameAndLocation“, der Teil des Blocks „CounterpartyIdentification“ der Meldung ist, werden aktuell nicht für die Geldmarktstatistik genutzt und demzufolge nicht in der folgenden Tabelle aufgeführt.

Name der Variablen	Beschreibung
REPORTED TRANSACTION STATUS (Transaktionsstatus)	Diese Variable enthält Informationen über den Status der Transaktion, d. h. darüber, ob es sich um eine neue Transaktion, ein Amendment einer früher gemeldeten Transaktion, eine Cancellation einer früher gemeldeten

Name der Variablen	Beschreibung
	Transaktion oder eine Correction einer bereits gemeldeten und abgewiesenen Transaktion handelt.
NOVATION STATUS (Novationsstatus)	Diese Variable spezifiziert, ob es sich bei der Transaktion um eine Novation handelt, d. h. um eine Transaktion, bei der u. a. die Gegenpartei geändert wurde. Änderungen der Gegenpartei aufgrund von Geschäftsvorfällen (wie z. B. Fusionen) sind nicht als Novationen zu melden.  <i>Liegt eine Novation vor, ist dieses Feld ein Pflichtfeld.</i>
UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER (Eindeutige Transaktionskennung; UTI)	Diese Variable enthält die UTI, bei der es sich um eine eindeutige Kennziffer zur Identifikation einer Transaktion in dem jeweiligen Marktsegment handelt.  <i>Zu melden, sofern zum Zeitpunkt der Einreichung der Geldmarktstatistik verfügbar.</i>
PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung; PTI)	Diese Kennung ist die eindeutige interne Transaktionskennung, die der Berichtspflichtige für jede Transaktion verwendet. Die PTI, die für jede Transaktion zu übermitteln ist und mit der diese identifiziert werden kann, muss pro Marktsegment und Berichtspflichtigem einmalig sein.
RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Zugehörige interne Transaktionskennung)	Bei dieser Variable handelt es sich um die eindeutige interne Transaktionskennung, die der Berichtspflichtige für die ursprüngliche Transaktion verwendet hat, die durch eine Novation ersetzt wurde.  <i>Liegt eine Novation vor, ist dieses Feld ein Pflichtfeld.</i>
COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung der Gegenpartei)	Diese Variable enthält die derselben Transaktion von der Gegenpartei des Berichtspflichtigen zugewiesene PTI.  <i>Bei Verfügbarkeit zu melden.</i>
COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei)	Diese Variable enthält die LEI der Gegenpartei des Berichtspflichtigen.  Dieses Feld ist ein Pflichtfeld für alle Gegenparteien, die über eine LEI verfügen. Handelt es sich bei der Gegenpartei um eine Zweigniederlassung, ist die LEI der Muttergesellschaft, d. h. des Rechtsträgers, der die Zweigniederlassung gegründet hat und kontrolliert, zu melden. Wird die Transaktion über eine CCP (Central Clearing Counterparty) abgeschlossen, ist in diesem Feld die LEI der CCP zu melden.

Name der Variablen	Beschreibung
	<p>In allen anderen Fällen, z. B. wenn die Gegenpartei über keine LEI verfügt, darf diese Variable nicht im XML-Schema enthalten sein, und es sind stattdessen der COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei) und die COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei) zu melden.</p> <p>Diese Variable wird in der MMSR message als „LEI“ bezeichnet und befindet sich im Block „CounterpartyIdentification“.</p>
<p>COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei)</p>	<p>Mit dieser Variablen wird der Sektor der Gegenpartei, z. B. nichtfinanzielle Kapitalgesellschaft oder Zentralbank, angegeben.</p> <p><i>Der COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei) ist für alle Transaktionen zu melden, bei denen die COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei) nicht angegeben ist.</i></p> <p>Diese Variable wird in der MMSR message als „Sector“ bezeichnet und befindet sich im Block „SectorAndLocation“ des Blocks „CounterpartyIdentification“.</p>
<p>COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei)</p>	<p>Diese Variable beinhaltet den ISO-Ländercode des Landes, in dem die Gegenpartei ihren Sitz hat.</p> <p><i>Die COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei) ist für alle Transaktionen zu melden, bei denen die COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei) nicht angegeben ist.</i></p> <p>Diese Variable wird in der MMSR message als „Location“ bezeichnet und befindet sich im Block „SectorAndLocation“ des Blocks „CounterpartyIdentification“.</p>
<p>TRADE DATE (Handelstag)</p>	<p>Beim Handelstag handelt es sich um den Tag und die Uhrzeit, an denen die Parteien die gemeldete Transaktion vereinbart haben. Sollte die Uhrzeit der Transaktion nicht verfügbar sein, ist nur deren Datum zu melden.</p> <p>Die zu meldende Uhrzeit ist die Ausführungszeit (sofern verfügbar) oder alternativ die Zeit, zu der die Transaktion im Buchungssystem des Berichtspflichtigen erfasst wird. Die Zeit ist stets als realer Zeitpunkt und nicht als Standardwert (z. B. Mitternacht) anzugeben.</p> <p>Das TRADE DATE (Handelstag) hat stets an oder vor dem START DATE (Starttag) zu liegen.</p> <p>Ausnahmen sind lediglich bei Novationen oder in den Fällen zulässig, in denen die Gegenparteien eine vor dem TRADE DATE beginnende</p>

Name der Variablen	Beschreibung
	Zinsberechnung vereinbart haben. Trifft eine der beiden Ausnahmen zu, kann ein nach dem START DATE liegendes TRADE DATE gemeldet werden.
START DATE (Starttag)	Der Starttag bezeichnet den Tag, an dem der Übernacht-Zinssatz der variablen Seite (Floating Leg) berechnet wird.
MATURITY DATE (Fälligkeitstag)	Der Fälligkeitstag bezeichnet den letzten Tag des Zeitraums, über den der zusammengesetzte Übernacht-Zinssatz berechnet wird.
FIXED INTEREST RATE (Festzinssatz)	Diese Variable enthält den bei der Berechnung der OIS-Auszahlung verwendeten Festzinssatz. Der Wert kann je nach Vereinbarung entweder positiv oder negativ sein – unabhängig vom Transaktionsvorzeichen.  Der Wert des Festzinssatzes darf nicht - zum Beispiel durch Division oder Multiplikation durch bzw. mit 10 oder 100 - umgerechnet oder angepasst werden.
OIS TRANSACTION TYPE (Art der Transaktion)	Diese Variable dient dazu, anzugeben, ob der Festzinssatz vom Berichtspflichtigen gezahlt oder empfangen wird.  Diese Variable wird in der MMSR message als „TransactionType“ bezeichnet.
TRANSACTION NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Transaktion)	Diese Variable enthält den Nennwert des OIS. In der MMSR message muss angegeben werden, dass es sich bei der Währung um Euro handelt.

## 6.2 Felddefinitionen für Daten zu Overnight Index Swaps (Tabelle 4)

Variable	Name der Variablen	Art	Beispiel
O10	REPORTED TRANSACTION STATUS (Transaktionsstatus)	Zeichenkette. Länge: 4 CL_REPORTED_TRANSACTION_STATUS (siehe Anhang I)	

Variable	Name der Variablen	Art	Beispiel
O15	NOVATION STATUS (Novationsstatus)	Zeichenkette. Länge: 4 CL_NOVATION_STATUS (siehe Anhang 1)	
O20	UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER (Eindeutige Transaktionskennung; UTI)	Zeichenkette. Maximale Länge: 105 Eindeutige Transaktionskennung (UTI) Bis zu 105 alphanumerische Zeichen. Es sind vier Sonderzeichen zulässig: „.“, „.“, „-“, „_“ Am Anfang und am Ende sind keine Sonderzeichen zulässig. Keine Leerzeichen zulässig	
O30	PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung; PTI)	Zeichenkette. Maximale Länge: 105 Eindeutige Identifikationsnummer für Transaktionen je Berichtspflichtigem und Marktsegment.	
O35	RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Zugehörige interne Transaktionskennung)	Zeichenkette. Maximale Länge: 105	
O40	COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung der Gegenpartei)	Zeichenkette. Maximale Länge: 105	
O50	COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei)	Zeichenkette. Länge: 20 Die LEI ist ein 20-stelliger alphanumerischer Code, der mit wichtigen Referenzinformationen verknüpft ist und eine klare und eindeutige Identifizierung von Unternehmen ermöglicht, die an den globalen Finanzmärkten agieren.	„QS3ZEAHRBZY9228 Z0111“ ist die LEI der Commerzbank International S.A.

Variable	Name der Variablen	Art	Beispiel
		[ISO 17442]	
O60	COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei)	Zeichenkette. Maximale Länge: 4 Bezieht sich auf die institutionellen Sektoren nach ESVG 2010 <sup>33</sup> . CL_COUNTERPARTY_SECTOR (siehe Anhang I)	„S11“ steht für „Nichtfinanzielle Kapitalgesellschaft“.
O70	COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei)	Zeichenkette. Länge: 2 [ISO 3166-1 Alpha-2] CL_COUNTRY (siehe Anhang I)	„DE“ steht für Deutschland.
O80	TRADE DATE (Handelstag)	Tag und Uhrzeit [ISO 8601] YYYY-MM-DDThh:mm:ss+/-hh:mm <i>oder</i> YYYY-MM-DDThh:mm:ss.sss+/-hh:mm Die Angabe der Zeitzone („+/-hh:mm“) muss stets enthalten sein. Lokale Zeitformate (d. h. ohne „+/-hh:mm“) sind nicht zulässig; <i>oder</i> Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD Das Datum muss stets der MEZ-Zeitzone entsprechen.	„2014-11- 26T09:00:00+00:00“ steht für den 26. November 2014, 9:00 Uhr lokaler Zeit (GMT). <i>oder</i> „2014-11-26“ steht für den 26. November 2014 (MEZ).
O90	START DATE (Starttag)	Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD Das Datum muss stets der MEZ-Zeitzone entsprechen.	„2014-11-26“ steht für den 26. November 2014 (MEZ).
O100	MATURITY DATE (Fälligkeitstag)	Datum [ISO 8601] YYYY-MM-DD Das Datum muss stets der MEZ-Zeitzone entsprechen.	„2014-11-26“ steht für den 26. November 2014 (MEZ).

<sup>33</sup> Die vollständige Liste der institutionellen Sektoren nach ESVG 2010 kann im Eurostat-Bereich der Website der Europäischen Kommission unter „www.europa.eu“ abgerufen werden.

Variable	Name der Variablen	Art	Beispiel
O110	FIXED INTEREST RATE (Festzinssatz)	Numerisch Positive oder negative Zahl Maximale Gesamtlänge: 11 Dezimalstellen: bis zu 10 Einheit: Prozentpunkte	3.235 steht für einen Festzinssatz von 3,235 %
O120	OIS TRANSACTION TYPE (Art der Transaktion)	Zeichenkette. Länge: 4 CL_OIS_TRANSACTION_TYPE (siehe Anhang I)	„PAID“ steht für den vom Berichtspflichtigen gezahlten Festzinssatz.
O130	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Transaktion)	Numerisch. Maximale Gesamtlänge: 18 Positive Zahl Dezimalstellen: bis zu 5 Währung [ISO 4127]	1000000 EUR, wobei „EUR“ für Euro steht. Die gemeldete Währung muss stets Euro sein.

Zusätzlich zu den in der vorstehenden Tabelle mit den Felddefinitionen zur Verfügung gestellten Informationen gelten die folgenden allgemeinen Regeln für die Meldung von ganzen Zahlen und Dezimalstellen für numerische Variablen:

- Ganze Zahlen müssen immer mit exakter Genauigkeit gemeldet und dürfen nicht gerundet werden.  
Beispiel: Tatsächlicher Nennwert der Transaktion = 55.200.300,23  
Korrekte Meldung: Tatsächlicher Nennwert der Transaktion = 55200300.23  
Fehlerhafte Meldung: Tatsächlicher Nennwert der Transaktion = 55200000
- Dezimalstellen müssen entsprechend der Felddefinitionen gemeldet werden, und es muss die maximal zur Verfügung stehende Anzahl von Dezimalstellen angegeben werden.  
Beispiel: Tatsächlicher Festzinssatz = 0,15479  
Korrekte Meldung: Festzinssatz = 0.15479  
Fehlerhafte Meldung: Festzinssatz = 0.15

## ANHANG I: CODELISTEN

Name der Codeliste	Inhalt	Beschreibung
CL_CALL_PUT	CALL	Call (Kaufoption)
	PUTO	Put (Verkaufsoption)
CL_FCC	Siehe ISO 4217	
CL_CFI	Siehe ISO 10962	
CL_COLLATERAL_ISSUER_SECTOR	S11	Nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften
	S12	Finanzielle Kapitalgesellschaften
	S121	Zentralbank
	S122	Kreditinstitute, ohne die Zentralbank
	S123	Geldmarktfonds
	S124	Investmentfonds, ohne Geldmarktfonds
	S125	Sonstige Finanzinstitute, ohne Versicherungsgesellschaften und Altersvorsorgeeinrichtungen
	S126	Kredit- und Versicherungshilfstätigkeiten
	S127	Firmeneigene Finanzierungseinrichtungen und Kapitalgeber
	S128	Versicherungsgesellschaften
	S129	Altersvorsorgeeinrichtungen
	S13	Staat
	S14	Private Haushalte
	S15	Private Organisationen ohne Erwerbszweck
	CL_COLLATERAL_POOL	POOL
NOPL		Einzelne und mehrere individuelle Sicherheiten (Single oder Multiple Collateral)
CL_COUNTERPARTY_SECTOR	S11	Nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften
	S121	Zentralbank
	S122	Kreditinstitute, ohne die Zentralbank
	S123	Geldmarktfonds

	S124	Investmentfonds, ohne Geldmarktfonds
	S125	Sonstige Finanzinstitute, ohne Versicherungsgesellschaften und Altersvorsorgeeinrichtungen
	S126	Kredit- und Versicherungshilfstätigkeiten
	S127	Firmeneigene Finanzierungseinrichtungen und Kapitalgeber
	S128	Versicherungsgesellschaften
	S129	Altersvorsorgeeinrichtungen
	S13	Staat
CL_COUNTRY	Siehe ISO 3166-1 Alpha-2	
CL_DATASETACTION	NOTX	Fehlanzeige (No transaction)
CL_FX_TRANSACTION_TYPE	BUYI	Nennwert der Transaktion in Euro wird am Valutatag gekauft.
	SELL	Nennwert der Transaktion in Euro wird am Valutatag verkauft.
CL_INSTRUMENT_TYPE	DPST	Einlage (Deposit)
	CACM	Tagesgeld / Sparkonto (Call Account/Call Money)
	CEOD	Einlagenzertifikat (Certificate of Deposit)
	COPR	Commercial Paper
	ABCP	Asset Backed Commercial Paper
	FRNT	Variabel verzinsliche Schuldverschreibung (Floating Rate Note)
	OTHR	Sonstige kurzfristige Schuldverschreibungen (Other Short-term Debt Securities Issued)
CL_MARKET_SEGMENT	auth.012.001 .02	Besicherte Geldmarkttransaktionen
	auth.013.001 .02	Unbesicherte Geldmarkttransaktionen
	auth.014.001 .02	Devisenswapgeschäfte
	auth.015.001 .02	Overnight Index Swaps
CL_NOVATION_STATUS	NONO	Transaktion ist keine Novation.

	NOVA	Transaktion ist eine Novation.
CL_OIS_TRANSACTION_ TYPE	PAID	Der fixe Zinssatz wird vom Berichtspflichtigen gezahlt.
	RECE	Der Berichtspflichtige erhält den fixen Zinssatz.
CL_RATE_TYPE	FIXE	Fixer Zinssatz
	VARI	Variabler Zinssatz
CL_REPORTED_ TRANSACTION_STATUS	AMND	Korrektur (Amendment)
	CANC	Löschung (Cancellation)
	CORR	Korrektur (Correction)
	NEWT	Neue Transaktion (New Transaction)
CL_SPECIAL_COLLATERAL_ INDICATOR	GENE	Allgemeine Sicherheit (General Collateral)
	SPEC	Spezielle Sicherheit (Special Collateral)
	MRRP	Gematchtes Repo und reverse Repo (Matched repo and reverse repo)
CL_TRANSACTION_TYPE	BORR	Geldaufnahme (Borrowing)
	LEND	Geldvergabe (Lending)

## ANHANG II: DATA QUALITY CHECKS

Alle von Berichtspflichtigen gemeldeten Dateien werden durch die Deutsche Bundesbank auf Plausibilität geprüft, um ihre Qualität und Konsistenz zu untersuchen. Es wird empfohlen, dass Berichtspflichtige ähnliche Plausibilitätsprüfungen in ihrem System implementieren, um die Qualität ihrer Daten zu verbessern und so mögliche Änderungen an den Daten zu vermeiden.

Die Plausibilitätsprüfungen werden zusammen mit den Richtlinien in dem getrennten Dokument „Data Quality Checks (MMSR)“ auf der Homepage der Deutschen Bundesbank veröffentlicht. Dieses Dokument enthält die Plausibilitätsprüfungen in Form einer Auflistung von mehreren individuellen Validierungsregeln, die die gemeldeten Daten erfüllen müssen.

Die Plausibilitätsprüfungen umfassen vier verschiedene Attribute:

- (1) den Checknamen der Plausibilitätsprüfung, der der eindeutigen Identifizierung einer Validierungsregel dient und sich aus vier Elementen zusammensetzt.
  - o Zunächst beginnen alle Checknamen der Plausibilitätsprüfung mit denselben zwei Buchstaben „DQ“.
  - o Dieser Buchstabenkombination folgt ein weiterer Buchstabe, nämlich „U“ für den unbesicherten Geldmarkt, „S“ für den besicherten Geldmarkt, „F“ für Devisenswapgeschäfte und „O“ für Overnight Index Swaps (OIS) sowie zwei Ziffern, die für die zu prüfende Variable stehen, d. h. „10“, „20“ usw.
  - o Schließlich wird eine fortlaufende Nummer vergeben, die mit „0“ beginnt und die Validierungsregel für ein spezifisches Feld eindeutig identifiziert.

Beispiel für den Checknamen einer Plausibilitätsprüfung: „DQS100“ steht für die erste (0) Plausibilitätsprüfung (DQ) der ersten Variable (10) im besicherten Geldmarkt (S).

- (2) die Definition der Plausibilitätsprüfung, die in Worten den Fehler oder Warnhinweis beschreibt.
- (3) die Fehlerschwere, die zeigt, welchen Einfluss der Fehler auf den kompletten Datensatz hat. Dieses Attribut sagt aus, wie die Transaktion im Transaktionssystem behandelt wird.

Die möglichen Werte für die Fehlerschwere („Error Severity“) lauten wie folgt:

- o Ein Fehler oder blockierender Fehler („Error“) zeigt an, dass eine Transaktion abgewiesen wird und der Berichtspflichtige eine Korrektur einzureichen hat.
- o Ein Warnhinweis oder nicht-blockierender Fehler („Warning“) zeigt an, dass die Transaktion zwar angenommen wird, der Berichtspflichtige jedoch prüfen sollte, ob ein Fehler vorliegt und diesen gegebenenfalls korrigieren sollte.
- o „No Action“ zeigt an, dass die spezifizierte Prüfung nicht durchgeführt wird.

- (4) Die letzte Spalte beschreibt die Konsequenz nach der Durchführung der Plausibilitätsprüfung, z. B. „reject transaction“ („Transaktion abweisen“)

Berichtspflichtige sollten sich bewusst sein, dass die EZB und die NZBen neben den im Dokument „Data Quality Checks (MMSR)“ definierten Plausibilitätsprüfungen weitere Prüfungen durchführen können, um die Konsistenz der eingereichten Daten zu prüfen. Berichtspflichtige können zu diesem Zweck kontaktiert werden, um mögliche Datenqualitätsprobleme oder -inkonsistenzen näher zu erläutern.

### ANHANG III: ZUORDNUNG ZWISCHEN NAMEN VON VARIABLEN IN DEN RICHTLINIEN UND DER VERORDNUNG

Die Namen einiger Variablen wurden in den Meldeanweisungen leicht gegenüber den entsprechenden Feldern in der Verordnung angepasst. Die nachfolgende Tabelle gibt einen Überblick über die Zuordnung zwischen den jeweiligen Namen der Variablen und Felder.

Marktsegment	Verordnung	Richtlinien	Anmerkungen
Alle Marktsegmente	Handelstag	Handelstag	
	Elektronischer Zeitstempel		
	Berichtstag	Referenzperiode	
OIS-Marktsegment	Art der Transaktion	Art der Transaktion	

## ANHANG IV: LISTE VON ISIN-CODES FÜR REFERENZZINSSÄTZE

Bei variabel verzinslichen Transaktionen im besicherten und unbesicherten Marktsegment ist der jeweilige Referenzzinssatz anzugeben. Dieser ist über den entsprechenden ISIN-Code zu identifizieren.

In nachfolgender Liste sind die ISIN-Codes für die verschiedenen Referenzzinssätze aufgeführt<sup>34</sup>:

Referenzzinssatz	ISIN
Euro Short-Term Rate (€STR)	EU000A2X2A25
Durchschnittlicher €STR-Zinssatz mit Aufzinsung (Compounded euro short-term rate average rate), Laufzeit eine Woche	EU000A2QQF16
Durchschnittlicher €STR-Zinssatz mit Aufzinsung (Compounded euro short-term rate average rate), Laufzeit ein Monat	EU000A2QQF24
Durchschnittlicher €STR-Zinssatz mit Aufzinsung (Compounded euro short-term rate average rate), Laufzeit drei Monate	EU000A2QQF32
Durchschnittlicher €STR-Zinssatz mit Aufzinsung (Compounded euro short-term rate average rate), Laufzeit sechs Monate	EU000A2QQF40
Durchschnittlicher €STR-Zinssatz mit Aufzinsung (Compounded euro short-term rate average rate), Laufzeit zwölf Monate	EU000A2QQF57
EURIBOR 1 Woche (1 week EURIBOR)	EU0009678507
EURIBOR 1 Monat (1 month EURIBOR)	EU0009659937
EURIBOR 3 Monate (3 month EURIBOR)	EU0009652783
EURIBOR 6 Monate, Laufzeit sechs Monate (6 month EURIBOR)	EU0009652791
EURIBOR 12 Monate (12 month EURIBOR)	EU0009652809
EZB-Zinssatz für Hauptrefinanzierungsgeschäfte (Festsatztender (Mengentender)   Festsatz) (ECB MRO Rate (fixed rate tenders   fixed rate))	EU0000000009
EZB-Zinssatz für Hauptrefinanzierungsgeschäfte (Tender mit variablem Zinssatz (Zinstender)   Mindestbietungssatz) (ECB MRO Rate (variable rate tenders   minimum bid rate))	EU0000000008
EZB-Zinssatz für die Einlagefazilität (ECB Deposit Facility Rate)	EU0000000007
EZB-Zinssatz für die Spitzenrefinanzierungsfazilität (ECB Marginal Lending Facility Rate)	EU0000000006
Euro-Tagesgeld-Swapsatz, Laufzeit eine Woche (€STR) (Euro Overnight Index Swap 1-week (€STR))	EU0000000958
Euro-Tagesgeld-Swapsatz, Laufzeit ein Jahr (€STR) (Euro Overnight Index Swap 1-year (€STR))	EU0000000957

<sup>34</sup> Der Großteil dieser ISIN-Codes wird künstlich allein zu dem Zweck erstellt, um sie im Rahmen der Geldmarktstatistik berichtsfähig zu machen. Insofern sind sie nicht als marktfähig anzusehen.

## **ANHANG V: LISTE DER SUPRANATIONALEN ORGANISATIONEN**

Dieser Anhang ist nicht mehr relevant, wird aber aus Nummerierungsgründen beibehalten.

## ANHANG VI: LISTE DER MULTIPLIKATOREN ZUR BERECHNUNG DER FX FORWARD POINTS

Die Berechnung der Swap-Punkte bei Devisenswapgeschäften ist von dem Devisenkassa- und -terminkurs sowie von dem für die jeweilige Währung anzuwendenden Multiplikator abhängig.

Die folgende Tabelle enthält den Multiplikator je Währung, der zur Berechnung der Swap-Punkte bei Devisenswapgeschäften herangezogen werden muss:

Währung	Multiplikator	Währung	Multiplikator	Währung	Multiplikator	Währung	Multiplikator	Währung	Multiplikator
AED	10000	CVE	1000	KHR	100	PAB	10000	TZS	10000
AFN	10000	CZK	1000	KMF	10000	PEN	10000	UAH	10000
ALL	100	DJF	10000	KPW	100	PGK	10000	UGX	10000
AMD	1000	DKK	10000	KRW	100	PHP	10000	USD	10000
ANG	10000	DOP	10000	KWD	10000	PKR	10000	UYU	1
AOA	10000	DZD	10000	KYD	10000	PLN	10000	UZS	10000
ARS	10000	EGP	10000	KZT	100	PYG	10000	VEF	10000
AUD	10000	ERN	10000	LAK	10000	QAR	10000	VND	NA
AWG	10000	ETB	10000	LBP	10000	RON	10000	VUV	10000
AZN	10000	FJD	10000	LKR	10000	RSD	10000	WST	10000
BAM	100000	FKP	10000	LRD	10000	RUB	10000	XAF	10000
BBD	10000	GBP	10000	LSL	10000	RWF	10000	XCD	10000
BDT	10000	GEL	10000	LTL	10000	SAR	10000	XOF	10000
BGN	10000	GHS	10000	LVL	10000	SBD	10000	XPF	10000
BHD	10000	GIP	10000	LYD	10000	SCR	10000	YER	10000
BIF	10000	GMD	10000	MAD	10000	SDG	10000	ZAR	10000
BMD	10000	GNF	10000	MDL	10000	SEK	10000	ZMW	10000
BND	10000	GTQ	10000	MGA	10000	SGD	10000		
BOB	10000	GYD	10000	MKD	10000	SHP	10000		
BRL	10000	HKD	10000	MMK	100	SLL	10000		
BSD	10000	HNL	10000	MNT	10000	SOS	10000		
BTN	10000	HRK	10000	MOP	10000	SRD	10000		
BWP	10000	HTG	10000	MRO	10000	SSP	10000		
BYR	100	HUF	100	MVR	10000	STD	10000		
BYN	10000	IDR	100	MWK	10000	SVC	10000		
BZD	10000	ILS	10000	MXN	10000	SYR	10000		
CAD	10000	INR	10000	MYR	10000	SZL	10000		
CDF	100	IQD	10000	MZN	10000	THB	100		
CHF	10000	IRR	10000	NAD	10000	TJS	10000		
CLP	100	ISK	100	NGN	10000	TMT	10000		
CNY	10000	JMD	10000	NIO	10000	TND	10000		
CNH	10000	JOD	10000	NOK	10000	TOP	10000		
COP	100	JPY	100	NPR	10000	TRY	10000		
CRC	100	KES	100	NZD	10000	TTD	10000		
CUC/CUP	10000	KGS	10000	OMR	10000	TWD	10000		

## ANHANG VII: BEISPIELE

Dieser Abschnitt enthält auf Grundlage der vorangegangenen Informationen Beispiele für die Meldungen bestimmter besicherter und unbesicherter Transaktionen sowie von Devisenswapgeschäften und OIS-Geschäften.

### Besichertes Marktsegment

#### Beispiel 1: Repo-Geschäft

##### Textbeschreibung:

Berichtspflichtiger: BNP Paribas, Paris, Frankreich

Die BNP Paribas (Paris) verleiht eine französische Staatsanleihe (Obligation Assimilable du Trésor – OAT) (1,75 %, 11/2024) mit einem Nennbetrag von 100 Mio. EUR an die Crédit Agricole SA zu einem Gesamtpreis (all-in price)<sup>35</sup> von 106,90.

Handelstag: 6. November 2014. Abwicklungstag: 7. November 2014. Fälligkeitstag:  
14. November 2014

Repo-Satz: 0,01 %

Die BNP Paribas (Paris) meldet die folgende Matrix:

Variable	Name der Variablen	Beispiel
S10	REPORTED TRANSACTION STATUS (Transaktionsstatus)	NEWT
S15	NOVATION STATUS (Novationsstatus)	NONO
S20	UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER (Eindeutige Transaktionskennung; UTI)	R0MUWSFPU8MPRO8K5P83UT11
S30	PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung; PTI)	1
S35	RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Zugehörige interne Transaktionskennung)	
S40	COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung der Gegenpartei)	
S50	COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei)	OE8Q7VBN47SSB1Z4MB56

<sup>35</sup> Der Gesamtpreis (all-in price) steht für den sogenannten Dirty Price (d. h. den Preis einschließlich aller aufgelaufenen Zinsen).

Variable	Name der Variablen	Beispiel
S60	COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei)	
S70	COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei)	
S80	TRIPARTY AGENT IDENTIFICATION (Kennung des Tri-Party-Agents)	
S90	TRADE DATE (Handelstag)	2014-11-06T09:00:00+00:00
S100	SETTLEMENT DATE (Abwicklungstag)	2014-11-07
S110	MATURITY DATE (Fälligkeitstag)	2014-11-14
S120	TRANSACTION TYPE (Art der Transaktion)	BORR
S130	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT (Nennwert Der Transaktion)	106900000 EUR
S140	RATE TYPE (Art des Zinssatzes)	FIXE
S150	DEAL RATE (Zinssatz der Transaktion)	0.01
S160	REFERENCE RATE INDEX (Referenzzinssatz)	
S170	BASIS POINT SPREAD (Spread in Basispunkten)	
S180	COLLATERAL ISIN (ISIN der Sicherheit(en))	FR0011962398
S190	COLLATERAL POOL (Sicherheitenpool)	
S200	COLLATERAL TYPE (Art der Sicherheit(en))	
S210	COLLATERAL ISSUER SECTOR (Sektor des Emittenten der Sicherheit(en))	
S220	SPECIAL COLLATERAL INDICATOR (Kennzeichen für Special Collateral)	GENE
S230	COLLATERAL NOMINAL AMOUNT (Nennwert Der Sicherheit)	100000000 EUR
S240	COLLATERAL HAIRCUT (Sicherheitsabschlag)	0

## Beispiel 2: Darstellung des obigen Beispiels in XML

```

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8" standalone="yes"?>
<MMSRMessage xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.003.001.01">
  <AppHdr xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01">
    <Fr>
      <OrgId>
        <Id>
          <OrgId>
            <Othr>
              <Id>R0MUWSFPU8MPRO8K5P83</Id>
              <SchmeNm>
                <Cd>LEI</Cd>
              </SchmeNm>
            </Othr>
          </OrgId>
        </Id>
      </OrgId>
    </Fr>
    <To>
      <OrgId>
        <Id>
          <OrgId>
            <Othr>
              <Id>9W4ONDYI7MRRJYXY8R34</Id>
              <SchmeNm>
                <Cd>LEI</Cd>
              </SchmeNm>
            </Othr>
          </OrgId>
        </Id>
      </OrgId>
    </To>
    <BizMsgIdr>BNPA000001</BizMsgIdr>
    <MsgDefldr>auth.012.001.02</MsgDefldr>
    <BizSvc>ECB_MMSR_PROD</BizSvc>
    <CreDt>2014-11-06T17:30:00Z</CreDt>
  </AppHdr>
  <Document xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:auth.012.001.02">
    <MnyMktScrdMktSttstclRpt>
      <RptHdr>
        <RptgAgt>R0MUWSFPU8MPRO8K5P83</RptgAgt>
        <RefPrd>
          <FrDtTm>2014-11-05T18:00:00+01:00</FrDtTm>
          <ToDtTm>2014-11-06T18:00:00+01:00</ToDtTm>
        </RefPrd>
      </RptHdr>
      <ScrdMktRpt>
        <Tx>
          <RptdTxs>NEWT</RptdTxs>
          <UnqTxldr>R0MUWSFPU8MPRO8K5P83UT1</UnqTxldr>
          <PrtryTxldr>1</PrtryTxldr>
          <CtrPtyldr>
            <LEI>OE8Q7VBN47SSB1Z4MB56</LEI>
          </CtrPtyldr>
          <TradDt>
            <DtTm>2014-11-06T09:00:00+00:00</DtTm>
          </TradDt>
          <SttlmDt>2014-11-07</SttlmDt>
          <MtrtyDt>2014-11-14</MtrtyDt>
          <TxTp>BORR</TxTp>
          <TxNmnlAmt Ccy="EUR">106900000</TxNmnlAmt>
        </Tx>
      </ScrdMktRpt>
    </MnyMktScrdMktSttstclRpt>
  </Document>
</MMSRMessage>

```

```

<RateTp>FIXE</RateTp>
<DealRate>0.01</DealRate>
<Coll>
  <Valtn>
    <SnglColl>
      <NmnlAmt Ccy="EUR">100000000</NmnlAmt>
      <ISIN>FR0011962398</ISIN>
    </SnglColl>
  </Valtn>
  <Hrcut>0</Hrcut>
  <SpclCollInd>GENE</SpclCollInd>
</Coll>
</Tx>
</ScrdMktRpt>
</MnyMktScrdMktSttstclRpt>
</Document>
</MMSRMessage>

```

### Beispiel 3: Reverse Repo-Transaktion (Umgekehrtes Repo-Geschäft)

#### Textbeschreibung:

Berichtspflichtiger: Commerzbank, Frankfurt

Die Commerzbank führt eine Reverse Repo-Transaktion über die CCP A (EUREX Repo) durch.

Sicherheit: DE000A0AE077

Nennwert: 5 Mio. EUR. Nennwert der Sicherheit: 4.558.901 EUR

Repo-Satz: 1,5 %

Handelstag: 10. November 2014 um 11:03 Uhr. Abwicklungstag: 12. November 2014. Fälligkeitstag: 19. November 2014

Haircut (Sicherheitsabschlag): 2,12345 %<sup>36</sup>

#### Die Commerzbank meldet die folgende Matrix:

Variable	Name der Variablen	Wert
S10	REPORTED TRANSACTION STATUS (Transaktionsstatus)	NEWT
S15	NOVATION STATUS (Novationsstatus)	NONO
S20	UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER (Eindeutige Transaktionskennung; UTI)	851WYGNLUQLFZBSYGB56UT13
S30	PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung; PTI)	2
S35	RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION	

<sup>36</sup> Bei diesem Beispiel kann der Sicherheitsabschlag nicht aus den in der Textbeschreibung enthaltenen Informationen berechnet werden, da Informationen zum Dirty Price des Wertpapiers erforderlich würden.

Variable	Name der Variablen	Wert
	(Zugehörige Interne Transaktionskennung)	
S40	COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung der Gegenpartei)	
S50	COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei)	529900LN3S50JPU47S06
S60	COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei)	
S70	COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei)	
S80	TRIPARTY AGENT IDENTIFICATION (Kennung des Tri-Party-Agents)	549300298FD7AS4PPU70
S90	TRADE DATE (Handelstag)	2014-11-10T11:03:00+00:00
S100	SETTLEMENT DATE (Abwicklungstag)	2014-11-12
S110	MATURITY DATE (Fälligkeitstag)	2014-11-19
S120	TRANSACTION TYPE (Art der Transaktion)	LEND
S130	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Transaktion)	5000000 EUR
S140	RATE TYPE (Art des Zinssatzes)	FIXE
S150	DEAL RATE (Zinssatz der Transaktion)	1.5
S160	REFERENCE RATE INDEX (Referenzzinssatz)	
S170	BASIS POINT SPREAD (Spread in Basispunkten)	
S180	COLLATERAL ISIN (ISIN der Sicherheit(en))	DE000A0AE77
S190	COLLATERAL POOL (Sicherheitenpool)	
S200	COLLATERAL TYPE (Art der Sicherheit(en))	
S210	COLLATERAL ISSUER SECTOR (Sektor des Emittenten der Sicherheit(en))	
S220	SPECIAL COLLATERAL INDICATOR (Kennzeichen für Special Collateral)	GENE
S230	COLLATERAL NOMINAL AMOUNT	4558901 EUR

Variable	Name der Variablen	Wert
	(Nennwert der Sicherheit(en))	
S240	COLLATERAL HAIRCUT (Sicherheitsabschlag)	2.1235

## Unbesichertes Marktsegment

### Beispiel 4: Einlage

Textbeschreibung:

Berichtspflichtiger: BNP Paribas, Paris, Frankreich

Die BNP-Zweigniederlassung London erhält eine Einlage in Höhe von 100 Mio. EUR von einer nichtfinanziellen Kapitalgesellschaft mit Sitz in Frankreich .

Handelstag: 6. November 2014. Abwicklungstag: 10. November 2014. Fälligkeitstag: 10. Dezember 2014

Einlagenzinssatz: -0,05 %

Die BNP Paribas (Paris) meldet die folgende Matrix:

Variablen	Name der Variablen	Beispiel
U10	REPORTED TRANSACTION STATUS (Transaktionsstatus)	NEWT
U15	NOVATION STATUS (Novationsstatus)	NONO
U20	UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER (Eindeutige Transaktionskennung; UTI)	
U30	PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung; PTI)	3
U35	RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Zugehörige interne Transaktionskennung)	
U40	COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung der Gegenpartei)	
U50	COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei)	
U60	COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei)	S11

Variablen	Name der Variablen	Beispiel
U70	COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei)	FR
U80	TRADE DATE (Handelstag)	2014-11-06T21:00:00+00:00
U90	SETTLEMENT DATE (Abwicklungstag)	2014-11-10
U100	MATURITY DATE (Fälligkeitstag)	2014-12-10
U110	INSTRUMENT TYPE (Art des Instruments)	DPST
U120	TRANSACTION TYPE (Art der Transaktion)	BORR
U130	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Transaktion)	100000000 EUR
U140	TRANSACTION DEAL PRICE (Preis der Transaktion)	100
U150	RATE TYPE (Art des Zinssatzes)	FIXE
U160	DEAL RATE (Zinssatz der Transaktion)	-0.05
U170	REFERENCE RATE INDEX (Referenzzinssatz)	
U180	BASIS POINT SPREAD (Spread in Basispunkten)	
U190	CALL OR PUT (Kauf- oder Verkaufsoption)	
U200	FIRST CALL/PUT DATE (Erster Kauf-/Verkaufstag)	
U210	CALL/PUT NOTICE PERIOD (Kündigungsfrist der Kauf-/Verkaufsoption)	

### Beispiel 5: Darstellung des obigen Beispiels in XML

```

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8" standalone="yes"?>
<MMSRMessage xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.003.001.01">
  <AppHdr xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01">
    <Fr>
      <OrgId>
        <Id>
          <OrgId>
            <Othr>
              <Id>R0MUWSFPU8MPRO8K5P83</Id>
              <SchmeNm>
                <Cd>LEI</Cd>
              </SchmeNm>
            </Othr>
          </OrgId>
        </Id>
      </OrgId>
    </Fr>
  </AppHdr>
</MMSRMessage>

```

```

        </Id>
      </Orgld>
    </Fr>
  <To>
    <Orgld>
      <Id>
        <Orgld>
          <Othr>
            <Id>9W4ONDYI7MRRJYXY8R34</Id>
            <SchmeNm>
              <Cd>LEI</Cd>
            </SchmeNm>
          </Othr>
        </Orgld>
      </Id>
    </Orgld>
  </To>
  <BizMsgLdr>BNPA000003</BizMsgLdr>
  <MsgDefldr>auth.013.001.02</MsgDefldr>
  <BizSvc>ECB_MMSR_PROD</BizSvc>
  <CreDt>2014-11-07T17:30:00Z</CreDt>
</AppHdr>
<Document xmlns = "urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:auth.013.001.02">
  <MnyMktUscredMktSttstclRpt>
    <RptHdr>
      <RptgAgt>R0MUWSFPU8MPRO8K5P83</RptgAgt>
      <RefPrd>
        <FrDtTm>2014-11-06T18:00:00+01:00</FrDtTm>
        <ToDtTm>2014-11-07T18:00:00+01:00</ToDtTm>
      </RefPrd>
    </RptHdr>
    <UscredMktRpt>
      <Tx>
        <RptdTxs>NEWT</RptdTxs>
        <PrtryTxld>3</PrtryTxld>
        <CtrPtyld>
          <SctrAndLctn>
            <Sctr>S11</Sctr>
            <Lctn>FR</Lctn>
          </SctrAndLctn>
        </CtrPtyld>
        <TradDt>
          <DtTm>2014-11-06T21:00:00+00:00</DtTm>
        </TradDt>
        <SttlmDt>2014-11-10</SttlmDt>
        <MtrtyDt>2014-12-10</MtrtyDt>
        <TxTp>BORR</TxTp>
        <InstrmTp>DPST</InstrmTp>
        <TxNmnlAmt Ccy="EUR">100000000</TxNmnlAmt>
        <DealPric>100</DealPric>
        <RateTp>FIXE</RateTp>
        <DealRate>-0.05</DealRate>
      </Tx>
    </UscredMktRpt>
  </MnyMktUscredMktSttstclRpt>
</Document>
</MMSRMessage>

```

## Beispiel 6: Einlage

### Textbeschreibung:

Berichtspflichtiger: Deutsche Bank, Frankfurt

Die Deutsche Bank erhält eine Einlage von der BNP Paribas.

Nennwert: 1 Mio. EUR

Festzinssatz: -0,038 %

Handelstag: 10. November 2014. Abwicklungstag: 10. November 2014. Fälligkeitstag: 11. November 2014

Die Deutsche Bank meldet die folgende Matrix:

Variablen	Name der Variablen	Wert
U10	REPORTED TRANSACTION STATUS (Transaktionsstatus)	NEWT
U15	NOVATION STATUS (Novationsstatus)	NONO
U20	UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER (Eindeutige Transaktionskennung; UTI)	
U30	PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung; PTI)	4
U35	RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Zugehörige interne Transaktionskennung)	
U40	COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung der Gegenpartei)	
U50	COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei)	R0MUWSFPU8MPRO8K5P83
U60	COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei)	
U70	COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei)	
U80	TRADE DATE (Handelstag)	2014-11-10T11:04:00+00:00
U90	SETTLEMENT DATE (Abwicklungstag)	2014-11-10
U100	MATURITY DATE (Fälligkeitstag)	2014-11-11
U110	INSTRUMENT TYPE (Art des Instruments)	DPST
U120	TRANSACTION TYPE (Art der Transaktion)	BORR

Variablen	Name der Variablen	Wert
U130	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Transaktion)	1000000 EUR
U140	TRANSACTION DEAL PRICE (Preis der Transaktion)	100
U150	RATE TYPE (Art des Zinssatzes)	FIXE
U160	DEAL RATE (Zinssatz der Transaktion)	-0.038
U170	REFERENCE RATE INDEX (Referenzzinssatz)	
U180	BASIS POINT SPREAD (Spread in Basispunkten)	
U190	CALL OR PUT (Kauf- oder Verkaufsoption)	
U200	FIRST CALL/PUT DATE (Erster Kauf-/Verkaufstag)	
U210	CALL/PUT NOTICE PERIOD (Kündigungsfrist der Kauf-/Verkaufsoption)	

## Beispiel 7: Tagesgeldkonto

### Textbeschreibung:

Berichtspflichtiger: Deutsche Bank, Frankfurt

Die Deutsche Bank erhält ein Tagesgeld von Siemens.

Nennwert: 1 Mio. EUR

Festzinssatz: -0,038 %

Handelstag: 10. November 2014. Abwicklungstag: 10. November 2014. Fälligkeitstag: Tagesgeld

### Die Deutsche Bank meldet die folgende Matrix:

Variablen	Name der Variablen	Wert
U10	REPORTED TRANSACTION STATUS (Transaktionsstatus)	NEWT
U15	NOVATION STATUS (Novationsstatus)	NONO
U20	UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER (Eindeutige Transaktionskennung; UTI)	
U30	PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung; PTI)	5
U35	RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Zugehörige interne Transaktionskennung)	

Variablen	Name der Variablen	Wert
U40	COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung der Gegenpartei)	
U50	COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei)	
U60	COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei)	S11
U70	COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei)	DE
U80	TRADE DATE (Handelstag)	2014-11-10
U90	SETTLEMENT DATE (Abwicklungstag)	2014-11-10
U100	MATURITY DATE (Fälligkeitstag)	2014-11-11
U110	INSTRUMENT TYPE (Art des Instruments)	CACM
U120	TRANSACTION TYPE (Art der Transaktion)	BORR
U130	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Transaktion)	1000000 EUR
U140	TRANSACTION DEAL PRICE (Preis der Transaktion)	100
U150	RATE TYPE (Art des Zinssatzes)	FIXE
U160	DEAL RATE (Zinssatz der Transaktion)	-0.038
U170	REFERENCE RATE INDEX (Referenzzinssatz)	
U180	BASIS POINT SPREAD (Spread in Basispunkten)	
U190	CALL OR PUT (Kauf- oder Verkaufsoption)	
U200	FIRST CALL/PUT DATE (Erster Kauf-/Verkaufstag)	
U210	CALL/PUT NOTICE PERIOD (Kündigungsfrist der Kauf-/Verkaufsoption)	

## Beispiel 8: Tagesgeldkonto mit einer Kündigungsfrist von 30 Tagen

### Textbeschreibung:

Berichtspflichtiger: Commerzbank, Frankfurt

Die Commerzbank erhält ein Tagesgeld von einer NFC (nichtfinanziellen Kapitalgesellschaft).

Nennwert: 100 Mio. EUR

Festzinssatz: -0,041095 %

Handelstag: 11. April 2017. Abwicklungstag: 11. April 2017. Fälligkeitstag: Abwicklungstag + 30 Tage

Die Commerzbank meldet die folgende Matrix:

Variablen	Name der Variablen	Wert
U10	REPORTED TRANSACTION STATUS (Transaktionsstatus)	NEWT
U15	NOVATION STATUS (Novationsstatus)	NONO
U20	UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER (Eindeutige Transaktionskennung; UTI)	
U30	PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung; PTI)	98255451575454485
U35	RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Zugehörige interne Transaktionskennung)	
U40	COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung der Gegenpartei)	
U50	COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei)	
U60	COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei)	S11
U70	COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei)	AT
U80	TRADE DATE (Handelstag)	2017-04-11
U90	SETTLEMENT DATE (Abwicklungstag)	2017-04-11
U100	MATURITY DATE (Fälligkeitstag)	2017-05-11
U110	INSTRUMENT TYPE (Art des Instruments)	CACM
U120	TRANSACTION TYPE (Art der Transaktion)	BORR
U130	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Transaktion)	1000000000 EUR
U140	TRANSACTION DEAL PRICE (Preis der Transaktion)	100
U150	RATE TYPE (Art des Zinssatzes)	FIXE
U160	DEAL RATE (Zinssatz der Transaktion)	-0.041095

Variablen	Name der Variablen	Wert
U170	REFERENCE RATE INDEX (Referenzzinssatz)	
U180	BASIS POINT SPREAD (Spread in Basispunkten)	
U190	CALL OR PUT (Kauf- oder Verkaufsoption)	
U200	FIRST CALL/PUT DATE (Erster Kauf-/ Verkaufstag)	
U210	CALL/PUT NOTICE PERIOD (Kündigungsfrist der Kauf-/Verkaufsoption)	

## Beispiel 9: Commercial Paper

### Textbeschreibung:

Berichtspflichtiger: Deutsche Bank, Frankfurt

Die Deutsche Bank begibt ein auf EUR lautendes Commercial Paper, das an die BNP Paribas verkauft wurde.

Nennwert: 10 Mio. EUR. Zinssatz: 0,10 %. Handelstag: 10. November 2014. Abwicklungstag: 12. November 2014. Fälligkeitstag: 12. Mai 2015. Laufzeit: 181 Tage. Nettobarwert: 9.994.974,75 EUR

### Die Deutsche Bank meldet die folgende Matrix:

Variablen	Name der Variablen	Wert
U10	REPORTED TRANSACTION STATUS (Transaktionsstatus)	NEWT
U15	NOVATION STATUS (Novationsstatus)	NONO
U20	UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER (Eindeutige Transaktionskennung; UTI)	
U30	PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung; PTI)	6
U35	RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Zugehörige interne Transaktionskennung)	
U40	COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung der Gegenpartei)	
U50	COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei)	R0MUWSFPU8MPRO8K5P83

Variablen	Name der Variablen	Wert
U60	COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei)	
U70	COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei)	
U80	TRADE DATE (Handelstag)	2014-11-10
U90	SETTLEMENT DATE (Abwicklungstag)	2014-11-12
U100	MATURITY DATE (Fälligkeitstag)	2015-05-12
U110	INSTRUMENT TYPE (Art des Instruments)	COPR
U120	TRANSACTION TYPE (Art der Transaktion)	BORR
U130	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Transaktion)	10000000 EUR
U140	TRANSACTION DEAL PRICE (Preis der Transaktion)	99.9497475
U150	RATE TYPE (Art des Zinssatzes)	FIXE
U160	DEAL RATE (Zinssatz der Transaktion)	0.20005 <sup>37</sup>
U170	REFERENCE RATE INDEX (Referenzzinssatz)	
U180	BASIS POINT SPREAD (Spread in Basispunkten)	
U190	CALL OR PUT (Kauf- oder Verkaufsoption)	
U200	FIRST CALL/PUT DATE (Erster Kauf-/Verkaufstag)	
U210	CALL/PUT NOTICE PERIOD (Kündigungsfrist der Kauf-/Verkaufsoption)	

## Beispiel 10: Wandelanleihe

Textbeschreibung: Berichtspflichtiger: BNP Paribas, Paris, Frankreich

Die BNP-Zweigniederlassung London leiht sich via einer Wandelanleihe 10 Mio. EUR von der Société Générale.

Handelstag: 6. November 2014. Abwicklungstag: 7. November 2014. Fälligkeitstag: 7. November 2015.

Erster Kauf-/Verkaufstag: 7. Februar 2015

<sup>37</sup> Es ist zu beachten, dass der vorstehend genannte Zinssatz der Transaktion von 0,20005 eine Endfälligkeitsrendite auf Grundlage der tatsächlichen Cashflows im Gegensatz zum nominellen Kuponsatz darstellt. Der Zinssatz der Transaktion wird für jedes Instrument auf Basis der tatsächlichen Cashflows unter Verwendung der jeweiligen Marktkonventionen berechnet.

Zinssatz: +0,05 %

Die BNP Paribas (Paris) meldet die folgende Matrix:

Variablen	Name der Variablen	Beispiel
U10	REPORTED TRANSACTION STATUS (Transaktionsstatus)	NEWT
U15	NOVATION STATUS (Novationsstatus)	NONO
U20	UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER (Eindeutige Transaktionskennung; UTI)	
U30	PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung; PTI)	3
U35	RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Zugehörige interne Transaktionskennung)	
U40	COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung der Gegenpartei)	
U50	COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei)	O2RNE8IBXP4R0TD8PU41
U60	COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei)	
U70	COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei)	
U80	TRADE DATE (Handelstag)	2014-11-06T21:00:00+00:00
U90	SETTLEMENT DATE (Abwicklungstag)	2014-11-07
U100	MATURITY DATE (Fälligkeitstag)	2015-11-07
U110	INSTRUMENT TYPE (Art des Instruments)	OTHR
U120	TRANSACTION TYPE (Art der Transaktion)	BORR
U130	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Transaktion)	10000000 EUR
U140	TRANSACTION DEAL PRICE (Preis der Transaktion)	99.95002
U150	RATE TYPE (Art des Zinssatzes)	FIXE
U160	DEAL RATE (Zinssatz der Transaktion)	0.05

Variablen	Name der Variablen	Beispiel
U170	REFERENCE RATE INDEX (Referenzzinssatz)	
U180	BASIS POINT SPREAD (Spread in Basispunkten)	
U190	CALL OR PUT (Kauf- oder Verkaufsoption)	CALL
U200	FIRST CALL/PUT DATE (Erster Kauf-/Verkaufstag)	2015-02-07

## Segment Devisenswapgeschäfte

### Beispiel 11: Devisenswapgeschäft

#### Textbeschreibung:

Berichtspflichtiger: BNP Paribas, Paris, Frankreich

Die BNP verkauft EUR gegen JPY an die Crédit Agricole im Wert von 35 Mio. EUR. Handelstag: 6. November 2014. Valutatag: 12. November 2014. Fälligkeitstag: 13. Januar 2015. Kassakurs: 141

Forward Points (Swap-Punkte): -4,25

#### Die BNP meldet die folgende Matrix:

Variablen	Name der Variablen	Beispiel
F10	REPORTED TRANSACTION STATUS (Transaktionsstatus)	NEWT
F15	NOVATION STATUS (Novationsstatus)	NONO
F20	UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER (Eindeutige Transaktionskennung; UTI)	R0MUWSFPU8MPRO8K5P83UT111
F30	PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung; PTI)	7
F35	RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Zugehörige interne Transaktionskennung)	
F40	COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung der Gegenpartei)	
F50	COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei)	969500TJ5KRTCJQWXH05

Variablen	Name der Variablen	Beispiel
F60	COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei)	
F70	COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei)	
F80	TRADE DATE (Handelstag)	2014-11-06T11:39:00+00:00
F90	VALUE DATE (Valutatag)	2014-11-12
F100	MATURITY DATE (Fälligkeitstag)	2015-01-13
F110	FX TRANSACTION TYPE (Art Der Transaktion)	SELL
F120	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Transaktion)	35000000 EUR
F130	FOREIGN CURRENCY CODE (ISO-Code der Fremdwahrung)	JPY
F140	FOREIGN EXCHANGE SPOT RATE (Devisenkassakurs)	141
F150	FOREIGN EXCHANGE FORWARD POINTS (Swap-Punkte)	-4.25

## Beispiel 12: Darstellung des obigen Beispiels in XML

```

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8" standalone="yes"?>
<MMSRMessage xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.003.001.01">
  <AppHdr xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01">
    <Fr>
      <OrgId>
        <Id>
          <OrgId>
            <Othr>
              <Id>R0MUWSFPU8MPRO8K5P83</Id>
              <SchmeNm>
                <Cd>LEI</Cd>
              </SchmeNm>
            </Othr>
          </OrgId>
        </Id>
      </OrgId>
    </Fr>
    <To>
      <OrgId>
        <Id>
          <OrgId>
            <Othr>
              <Id>9W4ONDYI7MRRJYXY8R34</Id>
              <SchmeNm>

```

```

<Cd>LEI</Cd>
</SchmeNm>
</Othr>
</Orgld>
</Id>
</Orgld>
</To>
<BizMsgldr>BNPA000005</BizMsgldr>
<MsgDefldr>auth.014.001.02</MsgDefldr>
<BizSvc>ECB_MMSR_PROD</BizSvc>
<CreDt>2014-11-06T17:30:00Z</CreDt>
</AppHdr>
<Document xmlns = "urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:auth.014.001.02">
  <MnyMktFXSwpsSttstclRpt>
    <RptHdr>
      <RptgAgt>R0MUWSFPU8MPRO8K5P83</RptgAgt>
      <RefPrd>
        <FrDtTm>2014-11-05T18:00:00+01:00</FrDtTm>
        <ToDtTm>2014-11-06T18:00:00+01:00</ToDtTm>
      </RefPrd>
    </RptHdr>
    <FXSwpsRpt>
      <Tx>
        <RptdTxs>NEWT</RptdTxs>
        <UnqTxldr>R0MUWSFPU8MPRO8K5P83UT11</UnqTxldr>
        <PrtryTxldr>7</PrtryTxldr>
        <CtrPtyldr>
          <LEI>OE8Q7VBN47SSB1Z4MB56</LEI>
        </CtrPtyldr>
        <TradDt>
          <DtTm>2014-11-06T11:39:00+00:00</DtTm>
        </TradDt>
        <SpotValDt>2014-11-12</SpotValDt>
        <MtrtryDt>2015-01-13</MtrtryDt>
        <TxTp>SELL</TxTp>
        <TxNmnlAmt Ccy="EUR">35000000</TxNmnlAmt>
        <FX>
          <FrgnCcy>JPY</FrgnCcy>
          <XchgSpotRate>141</XchgSpotRate>
          <XchgFwdPt>-4.25</XchgFwdPt>
        </FX>
      </Tx>
    </FXSwpsRpt>
  </MnyMktFXSwpsSttstclRpt>
</Document>
</MMSRMessage>

```

## Segment Overnight Index Swaps

### Beispiel 13: Overnight Index Swaps

#### Textbeschreibung:

Berichtspflichtiger: Deutsche Bank, Frankfurt

Die Deutsche Bank zahlt einen Festzinssatz an die BNP Paribas und erhält einen variablen Zinssatz.

Nennwert: 10 Mio. EUR. Festzinssatz: -0,01 %

Handelstag: 10. November 2014. Starttag: 12. November 2014. Fälligkeitstag: 19. November 2014

Die Deutsche Bank meldet die folgende Matrix:

Variablen	Name der Variablen	Wert
O10	REPORTED TRANSACTION STATUS (Transaktionsstatus)	NEWT
O15	NOVATION STATUS (Novationsstatus)	NONO
O20	UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER (Eindeutige Transaktionskennung; UTI)	7LTFWZYICNSX8D621K86UTI13
O30	PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung; PTI)	8
O35	RELATED PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Zugehörige interne Transaktionskennung)	
O40	COUNTERPARTY PROPRIETARY TRANSACTION IDENTIFICATION (Interne Transaktionskennung der Gegenpartei)	
O50	COUNTERPARTY IDENTIFICATION (Kennung der Gegenpartei)	R0MUWSFPU8MPRO8K5P83
O60	COUNTERPARTY SECTOR (Sektor der Gegenpartei)	
O70	COUNTERPARTY LOCATION (Sitzland der Gegenpartei)	
O80	TRADE DATE (Handelstag)	2014-11-10
O90	START DATE (Starttag)	2014-11-12
O100	MATURITY DATE (Fälligkeitstag)	2014-11-19
O110	FIXED INTEREST RATE (Festzinssatz)	-0.01
O120	OIS TRANSACTION TYPE (Art der Transaktion)	PAID
O130	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT (Nennwert der Transaktion)	10000000 EUR

### Beispiel 14: Darstellung des obigen Beispiels in XML

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8" standalone="yes"?>
<MMSRMessage xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.003.001.01">
  <AppHdr xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01">
    <Fr>
```

```

    <Orgld>
      <Id>
        <Orgld>
          <Othr>
            <Id>7LTFWZYICNSX8D621K86</Id>
            <SchmeNm>
              <Cd>LEI</Cd>
            </SchmeNm>
          </Othr>
        </Orgld>
      </Id>
    </Orgld>
  </Fr>
  <To>
    <Orgld>
      <Id>
        <Orgld>
          <Othr>
            <Id>529900SEOICVR2VM6Y05</Id>
            <SchmeNm>
              <Cd>LEI</Cd>
            </SchmeNm>
          </Othr>
        </Orgld>
      </Id>
    </Orgld>
  </To>
  <BizMsgldr>DEUT000007</BizMsgldr>
  <MsgDefldr>auth.015.001.02</MsgDefldr>
  <BizSvc>ECB_MMSR_PROD</BizSvc>
  <CreDt>2014-11-10T17:30:00Z</CreDt>
</AppHdr>
<Document xmlns = "urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:auth.015.001.02">
  <MnyMktOvrnghtIndxSwpsSttstclRpt>
    <RptHdr>
      <RptgAgt>7LTFWZYICNSX8D621K86</RptgAgt>
      <RefPrd>
        <FrDtTm>2014-11-09T18:00:00+01:00</FrDtTm>
        <ToDtTm>2014-11-10T18:00:00+01:00</ToDtTm>
      </RefPrd>
    </RptHdr>
    <OvrnghtIndxSwpsRpt>
      <Tx>
        <RptdTxSts>NEWT</RptdTxSts>
        <UnqTxIdr>7LTFWZYICNSX8D621K86UT113</UnqTxIdr>
        <PrtryTxId>8</PrtryTxId>
        <CtrPtyId>
          <LEI>R0MUWSFPU8MPRO8K5P83</LEI>
        </CtrPtyId>
        <TradDt>
          <Dt>2014-11-10</Dt>
        </TradDt>
        <StartDt>2014-11-12</StartDt>
        <MtrtyDt>2015-11-19</MtrtyDt>
        <FxdIntrstRate>-0.01</FxdIntrstRate>
        <TxTp>PAID</TxTp>
        <TxNmnlAmt Ccy="EUR">10000000</TxNmnlAmt>
      </Tx>
    </OvrnghtIndxSwpsRpt>
  </MnyMktOvrnghtIndxSwpsSttstclRpt>
</Document>
</MMSRMessage>

```