

Leitlinien

für den Datentransfer zwischen Transaktionsregistern gemäß der EMIR und der SFT-Verordnung

Inhalt

1	Anwendungsbereich.....	4
2	Rechtsrahmen, Abkürzungen und Begriffsbestimmungen	5
2.1	Rechtsrahmen.....	5
2.2	Abkürzungen	7
2.3	Glossar der Konzepte und Begriffe.....	8
3	Zweck.....	10
4	Einhaltung der Vorschriften und Berichtspflichten	12
4.1	Status der Leitlinien.....	12
4.2	Berichtspflichten.....	12
5	Änderungen der Leitlinien zum Datentransfer zwischen Transaktionsregistern gemäß der EMIR	13
5.1	Anhang I – Verfahren für den Datentransfer auf Ersuchen eines TR-Teilnehmers gemäß der EMIR	17
5.2	Anhang II – Migrationsverfahren im Falle des Widerrufs der Registrierung gemäß der EMIR	19
Leitlinien zum Datentransfer zwischen Transaktionsregistern gemäß der SFT-Verordnung .		22
1	Anwendungsbereich.....	22
2	Rechtsrahmen, Abkürzungen und Begriffsbestimmungen	23
2.1	Rechtsrahmen.....	23
2.2	Abkürzungen	25
2.3	Glossar der Konzepte und Begriffe.....	26
3	Zweck.....	28
4	Einhaltung der Vorschriften und Berichtspflichten	30
4.1	Status der Leitlinien.....	30
4.2	Berichtspflichten.....	30
5	Leitlinien zum Datentransfer zwischen Transaktionsregistern gemäß der SFT-Verordnung	31
5.1	Anhang I – Verfahren für den Datentransfer auf Ersuchen eines TR-Teilnehmers gemäß der SFT-Verordnung.....	38
5.2	Anhang II – Migrationsverfahren im Falle des Widerrufs der Registrierung gemäß der SFTR	40

1 Anwendungsbereich

Wer?

1. Diese Leitlinien gelten für Transaktionsregister (TR), die von der ESMA registriert oder anerkannt werden, für nationale zuständige Behörden (NCA) und für meldende Gegenparteien oder die in ihrem Namen meldenden Einrichtungen.

Was?

2. Die angenommenen Leitlinien beziehen sich auf:
 - a. die Meldung von Einzelheiten zu Derivaten durch Gegenparteien und CCPs gemäß Artikel 9 Absatz 1 der EMIR ohne Mehrfachmeldung,
 - b. die Verfahren zur Übertragbarkeit gemäß Artikel 78 Absatz 9 der EMIR;
 - c. den Transfer von Derivaten zwischen TR auf Antrag der Gegenparteien oder der in ihrem Namen meldenden Stelle oder in dem Fall, dass die Registrierung eines TR gemäß Artikel 79 Absatz 3 der EMIR widerrufen wurde;
 - d. die Aufzeichnung von Einzelheiten zu Derivaten gemäß Artikel 80 Absatz 3 der EMIR und
 - e. Artikel 21 Absatz 2 der RTS zur Registrierung (EMIR).

Wann?

3. Die bestehenden Leitlinien zum Datentransfer gemäß der EMIR gelten ab dem 16. Oktober 2017. Die Änderungen dieser Leitlinien gelten ab dem 3. Oktober 2022.

2 Rechtsrahmen, Abkürzungen und Begriffsbestimmungen

2.1 Rechtsrahmen

<i>EMIR</i>	Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. Juli 2012 über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister ¹
<i>Entwurf technischer Regulierungsstandards für die Meldung</i>	Delegierte Verordnung (EU) Nr. JJ/XXX der Kommission vom ... zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister durch technische Regulierungsstandards zur Festlegung der Mindestangaben der Meldungen an Transaktionsregister und zur Aufhebung der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 148/2013 der Kommission ²
<i>ESMA-Verordnung</i>	Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/77/EG der Kommission ³
<i>ITS für die Meldung</i>	Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 der Kommission vom 19. Dezember 2012 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards im Hinblick auf das Format und die Häufigkeit von Transaktionsmeldungen an Transaktionsregister gemäß der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister, geändert durch die Durchführungsverordnung (EU) 2017/105 der Kommission ⁴
<i>Leitlinien zu Positionen</i>	Leitlinien zur Positionsberechnung durch Transaktionsregister gemäß der EMIR ⁵

¹ ABI. L 201 vom 27.7.2012, S. 1.

² 3 Der Entwurf der RTS für die Meldung, der von der ESMA am 17.12.2020 angenommen wurde (ESMA74-362-824), wird der Europäischen Kommission zur Billigung vorgelegt.

³ ABI. L 331 vom 15.12.2010, S. 84.

⁴ ABI. L 352 vom 21.12.2012, S. 20.

⁵ ESMA70-151-1350

<i>MiFIR</i>	Delegierte Verordnung (EU) Nr. 600/2014 der Kommission vom 15. Mai 2014 über Märkte für Finanzinstrumente und zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 ⁶
<i>RTS für den Zugang zu Daten</i>	Delegierte Verordnung (EU) Nr. 151/2013 der Kommission vom 19. Dezember 2012 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister durch technische Regulierungsstandards für die von Transaktionsregistern zu veröffentlichenden und zugänglich zu machenden Daten sowie operationelle Standards für die Zusammenstellung und den Vergleich von Daten sowie den Datenzugang, geändert durch die Delegierte Verordnung (EU) 2017/1800 der Kommission und die Delegierte Verordnung (EU) 2019/361 der Kommission ⁷
<i>RTS für die Meldung</i>	Delegierte Verordnung (EU) Nr. 148/2013 der Kommission vom 19. Dezember 2012 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister bezüglich technischer Regulierungsstandards für die Mindestangaben der Meldungen an Transaktionsregister, geändert durch die Delegierte Verordnung (EU) 2017/104 der Kommission ⁸
<i>RTS für die Registrierung</i>	Delegierte Verordnung (EU) Nr. 150/2013 der Kommission vom 19. Dezember 2012 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister durch technische Regulierungsstandards, in denen die Einzelheiten eines Antrags auf Registrierung als Transaktionsregister festgelegt werden, geändert durch die Delegierte Verordnung (EU) 2019/362 der Kommission vom 13. Dezember 2018 ⁹

⁶ ABl. L 173 vom 12.6.2014, S. 84.

⁷ ABl. L 52 vom 27.6.2013, S. 33.

⁸ ABl. L 52 vom 23.2.2013, S. 1.

⁹ ABl. L 52 vom 27.6.2013, S. 25.

2.2 Abkürzungen

<i>CP</i>	Konsultationspapier
<i>CSV</i>	Kommagetrennte Werte
<i>EER</i>	Für die Meldung zuständige Stelle
<i>ESMA</i>	Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde
<i>EU</i>	Europäische Union
<i>EWR</i>	Europäischer Wirtschaftsraum
<i>EZB</i>	Europäische Zentralbank
<i>FSB</i>	Rat für Finanzmarktstabilität
<i>ISO</i>	Internationale Organisation für Normung
<i>ITS</i>	Technische Durchführungsstandards (ITS)
<i>LEI</i>	Rechtsträgerkennung
<i>NCA</i>	Nationale zuständige Behörde
<i>NZB</i>	Nationale Zentralbank
<i>Q&A</i>	Fragen und Antworten
<i>RSE</i>	Meldung einreichende Stelle
<i>SLA</i>	Service Level Agreement (Dienstgütevereinbarung)
<i>TR</i>	Transaktionsregister
<i>TRACE</i>	System für einen einzigen Zugang zu TR-Daten
<i>TRS</i>	Technische Regulierungsstandards
<i>XML</i>	Erweiterbare Auszeichnungssprache (Extensible Mark-up Language)

2.3 Glossar der Konzepte und Begriffe

Alle Definitionen, Konzepte und Begriffe, die in der EMIR, in den geltenden RTS für die Meldung und ITS für die Meldung sowie in den geltenden RTS für den Zugang zu Daten und in den Fragen und Antworten sowie in diesen Leitlinien verwendet werden, haben dieselbe Bedeutung.

Für die Zwecke dieser Leitlinien wurden die folgenden Begriffe definiert/beschrieben:

- „aktiver Kunde“ bezeichnet einen TR-Teilnehmer, der ausstehende Derivate in einem TR hat.
- „komprimierte Derivate“ bezeichnet Derivate, die aufgrund einer Komprimierung im Sinne von Artikel 2 Absatz 1 Nummer 47 MiFIR beendet wurden, und in einer Position enthaltene Derivate. Komprimierte Derivate beziehen sich daher auf eine Reihe von Derivaten zwischen zwei Gegenparteien, die vor ihrem ursprünglich festgelegten Fälligkeitstermin von den beiden Gegenparteien beendet wurden und nach den derzeitigen RTS für die Meldung mit der Art des Vorgangs „Z“ oder „P“ gekennzeichnet sind. Darüber hinaus wird gemäß dem Entwurf der RTS für die Meldung ein solcher Satz von Derivaten mit einer Kombination aus der Art des Vorgangs „TERM“ und der Art des Ereignisses „COMP“, einer Kombination der Art des Vorgangs „TERM“ und der Art des Ereignisses „INTP“ oder der Art des Vorgangs „POSC“ identifiziert.
- „fehlerhaftes Derivat“ bezeichnet ein Derivat, das einem Transaktionsregister aufgrund eines Fehlers gemeldet wird. Es wird in den derzeitigen RTS für die Meldung mit der Art des Vorgangs „E“ und im Entwurf der RTS für die Meldung mit der Art des Vorgangs „EROR“ bezeichnet.
- „Lebenszyklusereignisse“ umfassen alle Arten von Vorgängen, die für ein bestimmtes Derivat gemeldet werden.
- „fälliges Derivat“ ein Derivat, das einem TR gemeldet wird und zu einem bestimmten Zeitpunkt sein vertraglich vereinbartes Fälligkeitsdatum erreicht hat.
- „neues TR“ bezeichnet ein TR, an das ein TR-Teilnehmer gemäß Artikel 9 EMIR mit der Meldung von Derivaten begonnen hat oder zu beginnen beabsichtigt, obwohl diese Stelle ursprünglich entweder direkt oder über eine RSE Meldungen an das alte TR vorgenommen hat.
- „nicht aktiver Kunde“ bezeichnet einen TR-Teilnehmer, der keine ausstehenden Derivate mehr bei einem TR hat.
- „altes TR“ bezeichnet ein TR, dem ein TR-Teilnehmer Bericht erstattet hat oder dem die Derivate eines TR-Teilnehmers von einer RSE gemäß Artikel 9 EMIR gemeldet wurden, bei dem aber (i) der TR-Teilnehmer beschloss, die Meldung seiner vertraglichen Vereinbarungen einzustellen, oder (ii) die Registrierung des TR zurückgezogen wurde.

- „ausstehendes Derivat“ bezeichnet solche Derivate, einschließlich durch eine CCP geclearter Derivate, die an ein TR gemeldet werden, nicht fällig sind und nicht Gegenstand einer Meldung mit den Arten des Vorgangs „E“, „C“, „P“ oder „Z“ gemäß den geltenden RTS für die Meldung waren. Darüber hinaus bezeichnet der Begriff „ausstehendes Derivat“ gemäß dem Entwurf der RTS für die Meldung ein Derivat, das noch nicht fällig ist oder nicht Gegenstand von Meldungen mit den Arten des Vorgangs „TERM“, „EROR“ oder „POSC“ war. Darüber hinaus bezeichnet der Begriff „ausstehendes Derivat“ gemäß dem Entwurf der RTS für die Meldung ein Derivat, das Gegenstand einer Meldung mit der Art des Vorgangs „REVI“ war, auf die keine weitere Meldung mit der Art des Vorgangs „TERM“ oder „EROR“ folgte.
- „Übertragbarkeit“ bezeichnet die Möglichkeit, Aufzeichnungen im Zusammenhang mit Einzelheiten von Derivaten, die gemäß Artikel 9 der EMIR gemeldet wurden, vom alten TR auf das neue TR zu übertragen, wie sie in diesen Leitlinien definiert sind.
- „Positionen“ bezeichnet die Darstellung von Risikopositionen zwischen zwei Gegenparteien gemäß den Leitlinien für Positionen.
- „Abgleich“ bezeichnet das Verfahren, durch das die TR bestätigen, dass die beiden Seiten eines Derivats von jeder für die Verarbeitung Verantwortlichen mit denselben Informationen gemeldet wurden.
- „Ablehnungen“ bezeichnet Derivate, die von einem TR aufgrund von Fehlern in den von einer für die Meldung zuständigen Stelle oder einer für die Meldung zuständigen Stelle gemeldeten Informationen zurückgewiesen wurden.
- Als „die Meldung einreichende Stelle“ („Report submitting entity“, im Folgenden „RSE“), die einem der Felder der Gegenpartei der geänderten technischen Meldestandards ¹⁰ entspricht, wird die Stelle bezeichnet, die eine Vertragsbeziehung mit einem eingetragenen oder anerkannten TR eingegangen ist und die:
 - nur Derivate meldet, bei denen sie eine der Gegenparteien ist – in diesem Fall wäre sie entweder die meldende Gegenpartei des Kontrakts oder die andere Gegenpartei – und
 - Derivate meldet, bei denen sie eine der Gegenparteien sein kann oder nicht.
- „beendete Derivate“ im Sinne der RTS für die Meldung sind Derivate, die von den beiden Gegenparteien vor ihrem vertraglich vereinbarten Fälligkeitstermin beendet wurden und mit der Art des Vorgangs „C“ gekennzeichnet sind. Darüber hinaus wird gemäß dem Entwurf der RTS für die Meldung ein solcher Satz von Derivaten mit einer Kombination der Art des Vorgangs „TERM“ oder der Art des Vorgangs

¹⁰ <https://eur-lex.europa.eu/legal-content/DE/TXT/?uri=CELEX%3A32017R0104>

„POSC“ identifiziert. Gemäß dem Entwurf der RTS für die Meldung umfassen „beendete Derivate“ auch die vorstehend genannten komprimierten Derivate.

- „Transfer“ oder „Transfer (von Einzelheiten) von Derivaten“ eine Handlung oder einen Prozess zur Übertragung der Aufzeichnungen der Derivate vom alten TR in das neue TR.
- Ein „TR-Teilnehmer“¹¹ ist eine Einrichtung, die eine vertragliche Vereinbarung zum Zwecke der Meldung von Derivatekontrakten gemäß Artikel 9 der EMIR mit mindestens einem eingetragenen oder anerkannten TR geschlossen hat. Bei dem TR-Teilnehmer kann es sich um eine RSE, eine für die Meldung zuständige Stelle, eine meldende Gegenpartei oder eine zentrale Gegenpartei handeln.

3 Zweck

4. Ziel dieser Leitlinien ist es, innerhalb des Europäischen Finanzaufsichtssystems (ESFS) kohärente, effiziente und wirksame Aufsichtspraktiken zu schaffen und eine gemeinsame, einheitliche und kohärente Anwendung sicherzustellen, indem für die Transaktionsregister, die meldenden Gegenparteien und die für die Meldung zuständigen Stellen Klarheit darüber geschaffen wird, wie die Einhaltung der folgenden Bestimmungen der EMIR jederzeit sichergestellt werden kann:
 - a. Artikel 9 Absatz 1 Buchstabe e der EMIR, der Folgendes vorsieht: „Gegenparteien und CCPs, die die Einzelheiten von Derivatekontrakten melden müssen, stellen sicher, dass diese Einzelheiten korrekt und ohne Mehrfachmeldung gemeldet werden.“
 - b. Artikel 80 Absatz 3 der EMIR, der Folgendes vorsieht: „Ein Transaktionsregister zeichnet die gemäß Artikel 9 erhaltenen Informationen unverzüglich auf und bewahrt sie mindestens zehn Jahre lang nach Beendigung der betreffenden Kontrakte auf. Es wendet zeitnahe und effiziente Verfahren für die Aufzeichnung an, um Änderungen der aufgezeichneten Informationen zu dokumentieren.“
 - c. In Artikel 79 Absatz 3 der EMIR heißt es: „Ein Transaktionsregister, dessen Registrierung widerrufen wurde, muss für die ordnungsgemäße Ersetzung sorgen, einschließlich des Datentransfers auf andere Transaktionsregister und der Umleitung der Meldungen auf andere Transaktionsregister.“
 - d. Die Verfahren zur Übertragbarkeit gemäß Artikel 78 Absatz 9 der EMIR.
5. Die Leitlinien stützen sich auf Artikel 16 Absatz 1 der ESMA-Verordnung, der Folgendes vorsieht: „Um innerhalb des ESFS kohärente, effiziente und wirksame

¹¹ Mitunter spezifizieren einige TRs die Arten von TR-Teilnehmern näher, z. B. meldende, allgemein meldende, nicht meldende usw. Teilnehmer. Diese Unterkategorien sind im Sinne dieser Leitlinien transparent.

Aufsichtspraktiken zu schaffen und eine gemeinsame, einheitliche und kohärente Anwendung des Unionsrechts sicherzustellen, gibt die Behörde Leitlinien für alle zuständigen Behörden beziehungsweise alle Finanzmarktteilnehmer heraus und richtet Empfehlungen an eine oder mehrere zuständige Behörden oder ein oder mehrere Finanzmarktteilnehmer.“

6. Mit den geänderten Leitlinien zur Übertragung von Daten im Rahmen der EMIR werden drei Ziele verfolgt:
 - a. Beseitigung von Hindernissen für die Übertragbarkeit aus dem wettbewerbsorientierten TR-Umfeld und Gewährleistung, dass die TR-Teilnehmer von dem Umfeld mit mehreren TR profitieren können;
 - b. Sicherstellung der Qualität der für die Behörden verfügbaren Daten, einschließlich der von TRs vorgenommenen Aggregationen, auch in Fällen, in denen der TR-Teilnehmer das TR, an das er meldet, wechselt und ungeachtet der Gründe für einen solchen Wechsel;
 - c. Sicherstellung einer kohärenten und harmonisierten Methode zur Übertragung von Aufzeichnungen von einem TR auf ein anderes und zur Unterstützung der Kontinuität der Meldung und des Abgleichs in allen Fällen, auch im Falle des Widerrufs der Registrierung eines TR.
7. Ein Transfer von Daten in ein anderes TR kann aus verschiedenen Gründen erforderlich sein. Die Leitlinien befassen sich daher separat mit folgenden Situationen: einerseits solche, in denen (i) der Transfer aufgrund des Widerrufs der Registrierung des TR erfolgt, und andererseits Fälle, in denen (ii) der Transfer auf freiwilliger Basis und unter normalen Marktbedingungen erfolgt. Die Leitlinien 1 bis 15 sowie die Leitlinien 33 und 34 gelten für beide Situationen; die Leitlinien 16 bis 22 gelten nur für die freiwillige Übertragung und die Leitlinien 23 bis 32 gelten nur für den Widerruf der Registrierung eines TR. Die Anreize und Beweggründe für die jeweiligen Parteien sind in den beiden Fällen unterschiedlich, weshalb jeweils eine spezifische Herangehensweise erforderlich ist.
8. In den Leitlinien werden Grundsätze auf hoher Ebene festgelegt, die einerseits von den TR-Teilnehmern, z. B. RSE, Gegenparteien und CCPs, und andererseits von den TRs zu befolgen sind. Diese Grundsätze werden durch spezifische Verfahren ergänzt, die die rechtzeitige und solide Übertragung von Einzelheiten zu Derivaten gewährleisten sollen. Diese Leitlinien beziehen sich jedoch nicht auf Situationen, die keinen Datentransfer erfordern, etwa im Zusammenhang mit meldenden Gegenparteien, die sich entschlossen haben, an zwei oder mehrere TRs gleichzeitig zu melden.

4 Einhaltung der Vorschriften und Berichtspflichten

4.1 Status der Leitlinien

9. Gemäß Artikel 16 Absatz 3 der ESMA-Verordnung unternehmen die nationalen zuständigen Behörden, die TR, die meldenden Gegenparteien und die für die Meldung zuständigen Stellen alle erforderlichen Anstrengungen, um diesen Leitlinien nachzukommen.
10. Die hiervon betroffenen zuständigen Behörden sollten diesen Leitlinien nachkommen, indem sie sie ggf. in ihre einzelstaatlichen Rechts- und/oder Aufsichtsrahmen übernehmen; dies gilt auch für jene Leitlinien, die sich in erster Linie an die Finanzmarktteilnehmer richten. In diesem Fall sollten die zuständigen Behörden durch ihre Aufsicht sicherstellen, dass die Finanzmarktteilnehmer den Leitlinien nachkommen.
11. Die ESMA wird die Anwendung dieser Leitlinien durch TR im Rahmen ihrer laufenden direkten Aufsicht beurteilen.

4.2 Berichtspflichten

12. Die zuständigen Behörden, für die diese Leitlinien gelten, müssen die ESMA innerhalb von zwei Monaten ab dem Datum, an welchem die Leitlinien in allen Amtssprachen der EU auf der Website der ESMA veröffentlicht worden sind, darüber informieren, ob sie den Leitlinien (i) nachkommen, (ii) nicht nachkommen, jedoch beabsichtigen, ihnen nachzukommen, oder (iii) nicht nachkommen und nicht beabsichtigen, ihnen nachzukommen.
13. Für den Fall der Nichteinhaltung müssen die zuständigen Behörden der ESMA zudem innerhalb von zwei Monaten ab dem Datum, an welchem die Leitlinien in allen Amtssprachen der EU auf der Website der ESMA veröffentlicht worden sind, die Gründe für die Nichteinhaltung der Leitlinien mitteilen.
14. Eine Vorlage für entsprechende Mitteilungen steht auf der Website der ESMA zur Verfügung. Die ausgefüllte Vorlage ist an die ESMA zu senden.
15. Die TR sind nicht verpflichtet, mitzuteilen, ob sie diesen Leitlinien folgen werden.
16. Meldende Gegenparteien und in ihrem Namen meldende Einrichtungen sind nicht verpflichtet, zu melden, ob sie diesen Leitlinien nachkommen.

5 Änderungen der Leitlinien zum Datentransfer zwischen Transaktionsregistern gemäß der EMIR

17. Die Leitlinien 11, 15, 18, 19, 23 und 26 der bestehenden Leitlinien zum Datentransfer zwischen Transaktionsregistern gemäß der EMIR erhalten folgende Fassung:

Leitlinie 11. Die TR sollten sicherstellen, dass die TR-Teilnehmer vor dem Datentransfer an einem arbeitsfreien Tag die ausstehenden Derivate, die Gegenstand des Datentransfers sind, ändern, um der aktuellsten Meldepflicht spätestens am Freitag vor dem Wochenende, an dem die Übertragung stattfindet, bis 23:59:59 Uhr nachzukommen, und

- (i) im Falle der vollständigen Übertragung sollte das alte TR ab dem Beginn des Datentransfers keine Meldungen über Lebenszykluseignisse und Positionsdaten in Bezug auf die zu übertragenden Derivate akzeptieren,
- (ii) und darüber hinaus sollte der TR-Teilnehmer im Falle einer teilweisen Übertragung sicherstellen, dass die Lebenszykluseignisse in Bezug auf die Derivate den betreffenden TRs genau gemeldet werden.

Bei Übertragungen an Arbeitstagen müssen sich das alte TR und das neue TR vor dem Datentransfer auf einen Zeitpunkt einigen, bis zu dem die Änderungen der ausstehenden Derivate, die Gegenstand des Datentransfers sind, vom TR-Teilnehmer abgeschlossen werden sollten. Bei Übertragungen an Arbeitstagen sollten die Ziffern i und ii von dem alten TR und dem TR-Teilnehmer befolgt werden.

Leitlinie 15. Für den Fall, dass nicht alle im Migrationsplan erfassten Daten auf einmal übertragen werden können, sollten die TRs die Daten in folgender Reihenfolge übertragen:

- (i) den letzten Stand der erhaltenen ausstehenden Derivate („Handelsstand“);
- (ii) im Falle eines Widerrufs der Registrierung die Meldungen zu Lebenszykluseignissen für die ausstehenden Derivate;
- (iii) im Falle eines Widerrufs der Registrierung alle gekündigten, komprimierten und fälligen Derivate, die weiterhin der Anforderung gemäß Artikel 80 Absatz 3 der EMIR unterliegen, zusammen mit den relevanten Lebenszykluseignissen;
- (iv) im Falle des Widerrufs der Registrierung alle fehlerhaften Derivate, die weiterhin der Anforderung gemäß Artikel 80 Absatz 3 der EMIR unterliegen, zusammen mit den relevanten Lebenszykluseignissen;
- (v) im Falle eines Widerrufs der Registrierung alle abgelehnten Derivate, die vom TR-Teilnehmer gemeldet wurden und die Datenvalidierungen nicht bestanden haben;
- (vi) im Falle eines Widerrufs der Registrierung das Meldeprotokoll des alten TR in einem maschinenlesbaren Format, das den Grund oder die Gründe für eine Änderung, das Datum, den Zeitstempel und eine klare Beschreibung der Änderungen (einschließlich des alten und neuen Inhalts der relevanten Daten) in Bezug auf die übertragenen Derivate aufzeichnet; und

- (vii) im Falle des Widerrufs der Registrierung alle Daten über Ablehnungen, d. h. die Berichte für die Behörden, die die Zurückweisungen betreffen, im XML-Format, und alle Daten zum Abgleich, d. h. die Berichte für die Behörden im XML-Format in Bezug auf den Abstimmungsstatus.

Leitlinie 18. Im Falle eines Datentransfers auf Ersuchen eines TR-Teilnehmers und wenn die Registrierung des alten TR weder zurückgenommen wird noch das Verfahren zur Rücknahme läuft, ist nur der letzte Stand der ausstehenden Derivate, d. h. der „Handelsstand“, zu übertragen.

Leitlinie 19. Im Falle eines Datentransfers auf Ersuchen eines TR-Teilnehmers sollten das alte und das neue TR das in Anhang I beschriebene Verfahren für den Datentransfer auf Ersuchen eines TR-Teilnehmers gemäß der EMIR-Verordnung befolgen. Die TRs sollten sich so bald wie möglich, spätestens jedoch binnen zehn Arbeitstagen nach Eingang des entsprechenden Ersuchens auf einen Migrationsplan für den Datentransfer eines TR-Teilnehmers einigen.

Leitlinie 23. Im Falle des Widerrufs der Registrierung eines TR sollte der Datentransfer alle Einzelheiten zu den dem TR gemeldeten Derivaten, einschließlich der zurückgewiesenen, zusammen mit dem entsprechenden Meldeprotokoll und allen Daten über Zurückweisungen umfassen, d. h. die Berichte für die Behörden, die die Zurückweisungen betreffen, im XML-Format, und alle Daten über den Abgleich, d. h. die Berichte für die Behörden in Bezug auf den Abstimmungsstatus im XML-Format. Die unter Leitlinie 15 beschriebene Reihenfolge der Datenübertragung sollte eingehalten werden.

Leitlinie 26. Im Falle eines Widerrufs der Registrierung auf Ersuchen eines TR sollte es die ESMA im Voraus über das beabsichtigte Datum der Einstellung des Geschäftsbetriebs informieren und anschließend unverzüglich die TR-Teilnehmer, die anderen TR und die betreffenden nationalen zuständigen Behörden auf elektronischem Wege benachrichtigen. Bei TR mit mehr als 500 TR-Teilnehmern sollte die Frist für die Vorankündigung mindestens neun Monate betragen, bei TR mit 500 oder weniger als 500 TR-Teilnehmern mindestens sechs Monate.

18. Die neuen Leitlinien 30 bis 34 werden wie folgt zu den bestehenden Leitlinien für den Datentransfer zwischen Transaktionsregistern gemäß der EMIR hinzugefügt:

Leitlinie 30. Im Falle eines Widerrufs der Registrierung kann das neue TR den aktiven TR-Teilnehmern Gebühren für ihre nicht ausstehenden Derivatdaten in Rechnung stellen.

Leitlinie 31. Im Falle eines Widerrufs der Registrierung kann das neue TR nicht ausstehende derivative Daten unterschiedlicher Datenqualität und/oder solche, die in unterschiedlichen Formaten vorliegen, in separaten Datenbanken/Tabellen speichern. Das neue TR sollte auf Anfrage Anfragen von Behörden beantworten.

Leitlinie 32. Im Falle eines Widerrufs der Registrierung sollte das TR, dessen Registrierung widerrufen wird, dem neuen TR die erforderlichen technischen Informationen über die zu übertragenden Daten zur Verfügung stellen, um den Datentransfer an das neue TR und die anschließende Speicherung durch das neue TR zu erleichtern. Das alte TR sollte dem neuen

TR die zuvor genannten Informationen rechtzeitig zur Verfügung stellen, damit sich das neue TR bei Bedarf vorbereiten kann. Die technische Dokumentation sollte mindestens die folgenden Aspekte umfassen:

- (i) Zuordnung der Felder zu den EMIR-Feldern und
- (ii) technische Erläuterungen für jedes Feld.

Leitlinie 33. Vor und nach dem Transfer der Aufzeichnungen eines TR-Teilnehmers sollte der TR-Teilnehmer mit dem neuen und dem alten TR die Richtigkeit der folgenden aggregierten Informationen zu den Derivaten, die Gegenstand der Übertragung sind, in Übereinstimmung mit dem in Leitlinie 11 dargelegten Zeitplan überprüfen und bestätigen:

- (i) die Gesamtzahl der ausstehenden Derivate, wobei jedes Derivat durch die eindeutige Kombination der Felder „Meldende Gegenpartei“, „Andere Gegenpartei“ und „Eindeutige Transaktionskennung“ identifiziert wird, zusammen mit den entsprechenden Einschussmeldungen;
- (ii) die Gesamtzahl der Meldungen in Bezug auf Lebenszyklusereignisse dieser Derivate (falls diese übertragen werden);
- (iii) die Gesamtzahl der Aufzeichnungen in Bezug auf gekündigte, komprimierte und fällige Derivate in den letzten fünf Jahren, für die eine Aufzeichnungspflicht gemäß Artikel 9 Absatz 2 der EMIR besteht (falls diese übertragen werden);
- (iv) die Gesamtzahl der Aufzeichnungen in Bezug auf fehlerhafte Derivate in den letzten fünf Jahren, für die eine Aufzeichnungspflicht gemäß Artikel 9 Absatz 2 der EMIR besteht (falls diese übertragen werden).

Leitlinie 34. Wenn eine FC und eine NFC- ausstehende transferierte OTC-Derivate an zwei verschiedene TRs melden:

- (i) wenn die NFC- beschließt, selbst keine Meldung zu erstatten, sollten die ausstehenden Derivate der NFC- an das TR der FC übertragen werden, es sei denn, die FC beschließt, Kunde des TR der NFC- zu werden, und meldet die mit der NFC- geschlossenen Derivate an dieses TR.
- (ii) Wenn eine NFC ihren Status von einer NFC+ zu einer NFC- ändert und beschließt, ihre Derivate nicht selbst zu melden, sollte sie die Übertragung ihrer ausstehenden, mit der FC geschlossenen Derivate an das TR dieser FC ab dem Datum der Statusänderung beantragen, es sei denn, die FC beschließt, Kunde des TR der NFC zu werden, und die mit der NFC geschlossenen Derivate an dieses TR zu melden. Ebenso sollten bei jeder Änderung des Status einer NFC von einer NFC- zu einer NFC+ die mit der FC abgeschlossenen ausstehenden Derivate zurück an das TR der NFC übertragen werden, es sei denn, die NFC beschließt, Kunde des TR der FC zu werden und die mit der FC geschlossenen Derivate an dieses TR zu melden.

(iii) Für die Durchführung des Datentransfers wird weder von der nichtfinanziellen Gegenpartei noch von der finanziellen Gegenpartei (oder einer die Meldung einreichenden Stelle, die die Meldung in ihrem Namen vornimmt) erwartet, dass sie bei den Transaktionsregistern der anderen Gegenpartei verbleiben.

5.1 Anhang I – Verfahren für den Datentransfer auf Ersuchen eines TR-Teilnehmers gemäß der EMIR

A. Planung und Vorbereitung
<p>Nach Unterzeichnung der einschlägigen vertraglichen Vereinbarung mit dem TR-Teilnehmer übermittelt das neue TR dem alten TR den gemäß Leitlinie 3 erstellten Migrationsplan und einigt sich mit diesem darauf.</p> <p>Das neue TR setzt die zuständigen Behörden per E-Mail über den Transfer in Kenntnis.</p>
<p>Das alte TR legt mit dem TR-Teilnehmer die folgenden aggregierten Informationen bezüglich der Derivate des TR-Teilnehmers, die Gegenstand der Übertragung sind, fest und einigt sich mit diesem darauf:</p> <ul style="list-style-type: none"> ○ den letzten Stand der erhaltenen ausstehenden Derivate („Handelsstand“); ○ die Gesamtzahl der ausstehenden Derivate;
<p>Das alte TR sollte den TR-Teilnehmer gemäß Leitlinie 8 um eine Bestätigung der Richtigkeit der oben genannten Informationen gegenüber den eigenen Aufzeichnungen des TR-Teilnehmers¹² ersuchen. Im Falle einer Unstimmigkeit sollte das alte TR die entsprechenden Zahlen mit dem TR-Teilnehmer abgleichen und sich mit ihm auf die endgültige Liste der Derivatemeldungen einigen, die migriert werden. Das alte TR sollte sämtliche Unstimmigkeiten <i>frühestmöglich, spätestens jedoch binnen fünf Arbeitstagen</i> beseitigen.</p>
B. Ausführung des Transfers
<p>Sobald die Zahlen der Derivate und Aufzeichnungen bestätigt sind, sollte das alte TR mit der Generierung der relevanten Datei(en) gemäß Leitlinie 5 und den einschlägigen allgemeinen Grundsätzen fortfahren.</p> <p>Das alte und das neue TR führen den Migrationsplan aus. Das alte TR sollte die generierten Dateien auf das neue TR übertragen, das die Dateiübertragung bestätigt.</p> <p>In diesem Zusammenhang sollten die ausstehenden Derivate innerhalb eines festgelegten Wochenendes oder an einem vereinbarten Arbeitstag übertragen werden.</p>
C. Überprüfung der übertragenen Daten
<p>Das neue TR sollte die folgenden Zahlen und Informationen für die erhaltenen Aufzeichnungen bestimmen und die Vollständigkeit der Übertragung überprüfen:</p>

¹² Vgl. Artikel 9 Absatz 2 der EMIR: „Die Aufzeichnungen für von ihnen geschlossene Derivatekontrakte und Änderungen werden von den Gegenparteien noch mindestens fünf Jahre nach Beendigung des Kontrakts aufbewahrt.“ Falls ein meldender TR-Teilnehmer im Namen anderer meldet, sollte er auch deren Aufzeichnungen heranziehen.

<ul style="list-style-type: none"> ○ den letzten Stand der erhaltenen ausstehenden Derivate („Handelsstand“); ○ die Gesamtzahl der ausstehenden Derivate;
<p>Das neue TR sollte den TR-Teilnehmer gemäß Leitlinie 33 um eine Bestätigung der Richtigkeit der oben genannten Informationen gegenüber den eigenen Aufzeichnungen des TR-Teilnehmers¹³ ersuchen. Im Falle einer Unstimmigkeit sollten die beiden TRs versuchen, die entsprechenden Zahlen mit dem TR-Teilnehmer abzugleichen, bis eine Einigung erzielt wird.</p>
<p>D. Abschließende Mitteilungen</p>
<p>Das neue TR sollte alle TRs darüber in Kenntnis setzen, dass der meldende Teilnehmer zu ihm gewechselt ist. Diese Informationen sollten dazu dienen, das Verfahren zum Abgleich für die einschlägigen Derivate, die in das neue TR migriert wurden, zu erleichtern.</p>
<p>Das neue TR sollte die einschlägige(n) zuständige(n) nationale(n) Behörde(n) und die ESMA über den Abschluss des Transfers der Daten des TR-Teilnehmers unterrichten und die Arten der betroffenen Derivate identifizieren.</p>
<p>E. Aufzeichnung und sichere Datenlöschung</p>
<p>Das alte TR sollte die migrierten ausstehenden Derivate aus sämtlichen Datenaggregationen entfernen.</p>
<p>Das alte TR sollte die übertragenen Daten so lange, wie durch die allgemeinen Grundsätze vorgeschrieben, und gemäß den vor dem Transfer geltenden EMIR-Anforderungen aufbewahren.</p>
<p>Das alte TR sollte das Meldelogsbuch mindestens 10 Jahre lang nach der Kündigung der entsprechenden Verträge aufbewahren.</p>
<p>Das alte TR wird die übertragenen Daten vernichten/löschen, sobald dies nach den einschlägigen allgemeinen Grundsätzen für eine sichere Löschung/Vernichtung gestattet ist.</p>

¹³ Vgl. Artikel 9 Absatz 2 der EMIR: „Die Aufzeichnungen für von ihnen geschlossene Derivatekontrakte und Änderungen werden von den Gegenparteien noch mindestens fünf Jahre nach Beendigung des Kontrakts aufbewahrt.“ Falls ein meldender TR-Teilnehmer im Namen anderer meldet, sollte er auch deren Aufzeichnungen heranziehen.

5.2 Anhang II – Migrationsverfahren im Falle des Widerrufs der Registrierung gemäß der EMIR

<p>A. Anfängliche Mitteilungen</p> <p>(Freiwilliger Widerruf) Das TR unterrichtet die ESMA, die TR-Teilnehmer, sonstige beteiligte TRs und die nationalen zuständigen Behörden spätestens (gemäß Leitlinie 26) vor dem beabsichtigten Datum der Einstellung des Betriebs über sein Ersuchen um Widerruf seiner Registrierung (falls der Widerruf von dem TR beantragt wird).</p> <p>oder</p> <p>(Unfreiwilliger Widerruf) Die ESMA unterrichtet das(die) neue(n) TR(s) und die nationalen zuständigen Behörden darüber, dass das(die) neue(n) TR(s) Daten erhalten sollte(n), die ursprünglich dem alten TR gemeldet wurden (falls der Widerruf nicht von dem TR beantragt wird).</p>
<p>B. Planung und Vorbereitung</p> <p>Das alte TR informiert die TR-Teilnehmer über seine Absicht, den Betrieb einzustellen. Das(die) TR(s) erstellt(erstellen) den in Leitlinie 3 beschriebenen Migrationsplan und übermittelt(übermitteln) ihn der ESMA und dem(den) neuen TR(s). Die ESMA und die übrigen beteiligten TRs äußern mögliche Einwände oder Bedenken. Sobald diese ausgeräumt sind, einigen sich alle Parteien auf die Einzelheiten des Migrationsplans.</p> <p>Das alte TR identifiziert die Derivate, die Gegenstand der Übertragung sind, und übermittelt der ESMA und den übrigen beteiligten TRs (im Rahmen des Migrationsplans oder separat) die folgenden Informationen bezüglich der Derivate, die Gegenstand der Übertragung je TR sind:</p> <ul style="list-style-type: none"> ○ den letzten Stand der erhaltenen ausstehenden Derivate („Handelsstand“) ○ die Gesamtzahl der ausstehenden Derivate ○ die Gesamtzahl der Aufzeichnungen betreffend Lebenszyklusereignisse in Verbindung mit den ausstehenden Derivaten ○ die Gesamtzahl der Aufzeichnungen betreffend gekündigte, komprimierte und fällige Derivate ○ die Gesamtzahl der Aufzeichnungen betreffend fehlerhafte Derivate ○ die Gesamtzahl der Aufzeichnungen im Zusammenhang mit abgelehnten Derivaten, die vom TR-Teilnehmer gemeldet wurden und die Datenvalidierungen nicht bestanden haben ○ die Anzahl der Einträge im Meldeloggbuch ○ die Anzahl der Meldungen im XML-Format zu Zurückweisungen, die an Behörden weitergeleitet werden, und die Anzahl der Meldungen an Behörden im XML-Format, die den Abstimmungsstatus betreffen

C. Ausführung des Transfers

Sobald die Anzahl der Derivate und Aufzeichnungen bestätigt ist, sollte das alte TR mit der Generierung der relevanten Datei(en) gemäß Leitlinie 5 fortfahren.

Das alte TR und das(die) neue(n) TR(s) führen den Migrationsplan aus. Die generierten Daten werden vom alten TR auf das(die) neue(n) TR(s) übertragen, das(die) jede Übertragung bestätigt(bestätigen).

Die in Leitlinie 15 enthaltene Reihenfolge der Priorisierung von Derivaten und Aufzeichnungen wird eingehalten.

Falls möglich, sollten ausstehende Derivate während und innerhalb eines Wochenendes oder an einem vereinbarten Arbeitstag übertragen werden, wobei die entsprechenden Lebenszyklusereignisse und Bewertungen/Sicherheiten so bald wie möglich übermittelt werden sollten.

Wenn dies nicht möglich ist, sollten die ausstehenden Derivate nach TR-Teilnehmern in zwei oder mehr Chargen unterteilt werden, die an aufeinander folgenden Wochenenden oder an vereinbarten Arbeitstagen übertragen werden. Die entsprechenden Lebenszyklusereignisse je Charge sollten zum frühestmöglichen Zeitpunkt übertragen werden.

Die verbleibenden Derivate sollten so bald wie möglich übertragen werden.

Mögliche Probleme, die ermittelt werden, sowie die erzielten Fortschritte werden der ESMA rechtzeitig gemeldet.

D. Prüfung des Datentransfers

Das(die) neue(n) TR(s) sollte(n) die folgenden Zahlen und Informationen für die erhaltenen Aufzeichnungen bestimmen und die Vollständigkeit der Übertragung überprüfen:

- den letzten Stand der erhaltenen ausstehenden Derivate („Handelsstand“)
- die Gesamtzahl der ausstehenden Derivate
- die Gesamtzahl der Aufzeichnungen betreffend Lebenszyklusereignisse in Verbindung mit den ausstehenden Derivaten
- die Gesamtzahl der Aufzeichnungen betreffend gekündigte, komprimierte und fällige Derivate
- die Gesamtzahl der Aufzeichnungen betreffend fehlerhafte Derivate
- die Gesamtzahl der Aufzeichnungen im Zusammenhang mit abgelehnten Derivaten, die vom TR-Teilnehmer gemeldet wurden und die Datenvalidierungen nicht bestanden haben
- die Anzahl der Einträge im Meldeloggbuch

- die Gesamtzahl der Meldungen im XML-Format zu Zurückweisungen, die an Behörden weitergeleitet werden, und die Anzahl der Meldungen an Behörden im XML-Format, die den Abstimmungsstatus betreffen

Die neuen TRs sollten die ESMA und das alte TR über das Ergebnis der Prüfung unterrichten. Sollte die Überprüfung fehlschlagen, wird die Ursache von beiden Parteien (altes und neues TR) untersucht, und der Übertragungsprozess sollte so lange wiederholt werden, bis der Datentransfer erfolgreich ist.

E. Abschließende Mitteilungen

Die neuen TRs sollten die relevanten TR-Teilnehmer, alle verbleibenden TRs und die jeweiligen nationalen zuständigen Behörden (per E-Mail) über den erfolgreichen Abschluss der Übertragung in Kenntnis setzen.

F. Aufzeichnung und sichere Datenlöschung

Das alte TR sollte die übertragenen Daten so lange, wie in Leitlinie 28 angegeben, und gemäß den vor dem Transfer geltenden EMIR-Anforderungen aufbewahren.

Das alte TR sollte die übertragenen Daten, sobald dies gestattet ist, und entsprechend den einschlägigen Grundsätzen von Leitlinie 28 für eine sichere Löschung/Vernichtung vernichten/löschen.

Leitlinien zum Datentransfer zwischen Transaktionsregistern gemäß der SFT-Verordnung

1 Anwendungsbereich

Wer?

1. Diese Leitlinien gelten für Transaktionsregister (TRs), die von der ESMA registriert oder anerkannt werden, für nationale zuständige Behörden (NCA) und für meldende Gegenparteien oder die in ihrem Namen meldenden Einrichtungen.

Was?

2. Die angenommenen Leitlinien beziehen sich auf:
 - a. die Meldung der Einzelheiten von SFTs durch Gegenparteien oder Stellen, die in ihrem Namen gemäß Artikel 4 Absatz 1 der SFT-Verordnung Meldung erstatten;
 - b. die Verfahren für die Übertragbarkeit gemäß Artikel 78 Absatz 9 der EMIR, die in Artikel 5 Absatz 2 der SFT-Verordnung genannt werden;
 - c. den Transfer von SFT-Daten zwischen TRs auf Ersuchen der Gegenparteien oder der in ihrem Namen meldenden Stelle oder in dem Fall, dass die Registrierung eines TR gemäß Artikel 79 Absatz 3 der EMIR – auf den in Artikel 5 Absatz 2 der SFT-Verordnung verwiesen wird – widerrufen wurde;
 - d. die Aufzeichnung der Einzelheiten von SFTs gemäß Artikel 80 Absatz 3 der EMIR (Querverweis gemäß Artikel 5 Absatz 2 der SFTR-Verordnung); und
 - e. Artikel 21 Absatz 2 der RTS zur Registrierung gemäß der SFT-Verordnung.

Wann?

3. Diese Leitlinien gelten ab den 3. Oktober 2022.

2 Rechtsrahmen, Abkürzungen und Begriffsbestimmungen

2.1 Rechtsrahmen

<i>EMIR</i>	Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. Juli 2012 über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister ¹⁴
<i>ESMA-Verordnung</i>	Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/77/EG der Kommission ¹⁵
<i>ITS für die Meldung</i>	Durchführungsverordnung (EU) 2019/363 der Kommission vom 13. Dezember 2018 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards im Hinblick auf das Format und die Häufigkeit der Meldung der Einzelheiten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften an Transaktionsregister gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates und zur Änderung der Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 der Kommission im Hinblick auf die Verwendung von Codes für die Meldung von Derivatekontrakten ¹⁶
<i>Leitlinien zu Positionen</i>	Leitlinien zur Berechnung von SFT-Positionen durch Transaktionsregister gemäß der SFT-Verordnung ¹⁷
<i>Leitlinien zur Meldung gemäß SFT-Verordnung</i>	Leitlinien zur Meldung gemäß Artikel 4 und 12 der SFT-Verordnung ¹⁸
<i>RTS für den Zugang zu Daten</i>	Delegierte Verordnung (EU) 2019/357 der Kommission vom 13. Dezember 2018 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für den Zugang zu den

¹⁴ ABI. L 201 vom 27.7.2012, S. 1.

¹⁵ ABI. L 331 vom 15.12.2010, S. 84.

¹⁶ ABI. L 81 vom 22.3.2019, S. 85.

¹⁷ ESMA74-362-1986

¹⁸ ESMA70-151-270.

Einzelheiten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFT) in Transaktionsregistern¹⁹

RTS für die Datenaggregation

Delegierte Verordnung (EU) 2019/358 der Kommission vom 13. Dezember 2018 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für die Erhebung, die Überprüfung, die Aggregation, den Vergleich und die Veröffentlichung von Daten über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFT) durch Transaktionsregister²⁰

RTS für die Meldung

Delegierte Verordnung (EU) 2019/356 der Kommission vom 13. Dezember 2018 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur genauen Festlegung der an Transaktionsregister zu meldenden Einzelheiten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften²¹

RTS für die Registrierung

Delegierte Verordnung (EU) 2019/359 der Kommission vom 13. Dezember 2018 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards, in denen die Einzelheiten eines Antrags auf Registrierung oder Ausweitung der Registrierung als Transaktionsregister festgelegt werden²²

SFT-Verordnung

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. 648/2012²³

¹⁹ ABI. L 81 vom 22.3.2019, S. 22.

²⁰ ABI. L 81 vom 22.3.2019, S. 30.

²¹ ABI. L 81 vom 22.3.2019, S. 1.

²² ABI. L 81 vom 22.3.2019, S. 45.

²³ ABI. L 337 vom 23.12.2015, S. 1.

2.2 Abkürzungen

<i>CP</i>	Konsultationspapier
<i>CSV</i>	Kommagetrennte Werte
<i>EER</i>	Für die Meldung zuständige Stelle
<i>ESMA</i>	Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde
<i>EU</i>	Europäische Union
<i>EWR</i>	Europäischer Wirtschaftsraum
<i>EZB</i>	Europäische Zentralbank
<i>FSB</i>	Rat für Finanzmarktstabilität
<i>ISO</i>	Internationale Organisation für Normung
<i>ITS</i>	Technische Durchführungsstandards (ITS)
<i>LEI</i>	Rechtsträgerkennung
<i>NCA</i>	Nationale zuständige Behörde
<i>NZB</i>	Nationale Zentralbank
<i>Q&A</i>	Fragen und Antworten
<i>RSE</i>	Meldung einreichende Stelle
<i>SFT</i>	Wertpapierfinanzierungsgeschäft
<i>SFTP</i>	SSH-Dateiübertragungsprotokoll
<i>SLA</i>	Service Level Agreement (Dienstgütevereinbarung)
<i>TR</i>	Transaktionsregister
<i>TRACE</i>	System für einen einzigen Zugang zu TR-Daten
<i>TRS</i>	Technische Regulierungsstandards

XML

Erweiterbare Auszeichnungssprache (Extensible Mark-up Language)

2.3 Glossar der Konzepte und Begriffe

Alle Begriffsbestimmungen, Konzepte und Begriffe, die in der SFT-Verordnung, den aktuellen RTS für die Meldung (SFT-Verordnung) und den ITS für die Meldung (SFT-Verordnung) sowie in den geltenden RTS für den Zugang zu Daten (SFT-Verordnung) in den Fragen und Antworten und in diesen Leitlinien verwendet werden, haben dieselbe Bedeutung.

Für die Zwecke dieser Leitlinien wurden die folgenden Begriffe definiert/beschrieben:

- „aktiver Kunde“ bezeichnet einen TR-Teilnehmer, der ausstehende SFTs bei einem TR abgeschlossen hat.
- „für die Meldung verantwortliche Stelle“ (im Folgenden: ERR), wobei es sich um eines der Felder zur Gegenpartei der RTS für die Meldung (SFT-Verordnung) handelt, ist als die finanzielle Gegenpartei zu verstehen, die für die Meldung im Namen der anderen Gegenpartei verantwortlich ist.
- „fehlerhaftes SFT“ bezeichnet ein SFT, das einem TR aufgrund eines Fehlers gemeldet wird. Es wird mit der Art des Vorgangs „EROR“ gekennzeichnet.
- „Lebenszyklusereignisse“ umfassen alle Arten von Vorgängen, die für ein bestimmtes SFT gemeldet werden.
- „fälliges SFT“ bezeichnet ein SFT, das einem TR gemeldet wird und zu einem bestimmten Zeitpunkt sein vertraglich vereinbartes Fälligkeitsdatum erreicht hat.
- „neues TR“ bezeichnet ein TR, an das ein TR-Teilnehmer gemäß Artikel 4 der SFT-Verordnung mit der Meldung von SFT-Kontrakten begonnen hat oder zu beginnen beabsichtigt, obwohl diese Stelle ursprünglich entweder direkt oder über eine RSE dem alten TR Bericht erstattet hat.
- „nicht aktiver Kunde“ bezeichnet einen TR-Teilnehmer, der nicht mehr über ausstehende SFTs bei einem TR verfügt.
- „altes TR“ bezeichnet ein TR, dem ein TR-Teilnehmer gemäß Artikel 4 SFT-Verordnung eine RSE meldete oder an das die SFT-Verträge eines TR-Teilnehmers gemeldet wurden, bezüglich dessen der TR-Teilnehmer jedoch i) entschieden hat, die Meldung seiner vertraglichen Vereinbarungen zu beenden, oder ii) die Registrierung des TR widerrufen wurde.
- „Ausstehender SFT“ bezeichnet ein SFT, das noch nicht fällig ist oder für das keine Meldungen mit den Arten „EROR“, „ETRM“ oder „POSC“ gemäß Feld 98 der

Tabelle 2 in Anhang I der ITS für die Meldung (SFT-Verordnung) vorgenommen wurden.

- „Übertragbarkeit“ bezeichnet die Möglichkeit, Aufzeichnungen im Zusammenhang mit den Einzelheiten von SFTs, die gemäß Artikel 4 SFT-Verordnung gemeldet wurden, vom alten TR auf das neue TR zu übertragen, wie in diesen Leitlinien definiert.
- „Positionen“ bezeichnet die Darstellung von Risikopositionen zwischen zwei Gegenparteien gemäß den Leitlinien für Positionen (SFT-Verordnung).
- „Abgleich“ bezeichnet das Verfahren, durch das die Transaktionsregister bestätigen, dass die beiden Seiten eines SFT von jeder für die Meldung zuständigen Stelle mit denselben Informationen gemeldet wurden.
- „Ablehnungen“ bezeichnet SFTs, die von einem TR aufgrund von Fehlern in den von einer für die Meldung zuständigen Stelle oder einer für die Meldung zuständigen Stelle gemeldeten Informationen zurückgewiesen wurden.
- Als „die Meldung einreichende Stelle“ („Report submitting entity“, im Folgenden „RSE“), die einem der Felder der Gegenpartei der geänderten technischen Meldestandards ²⁴ entspricht, wird die Stelle bezeichnet, die eine Vertragsbeziehung mit einem eingetragenen oder anerkannten TR eingegangen ist und die:
 - nur Derivate meldet, bei denen sie eine der Gegenparteien ist – in diesem Fall wäre sie entweder die meldende Gegenpartei des Kontrakts oder die andere Gegenpartei – oder
 - SFTs meldet, bei denen sie eine der Gegenparteien sein kann oder auch nicht.
- „beendete SFTs“ bezeichnet SFTs, die von den beiden Gegenparteien vor ihrem vertraglich vereinbarten Fälligkeitstermin beendet wurden und die Art des Vorgangs „ETRM“ aufweisen.
- „Übertragung“ oder „Übertragung (von Einzelheiten) von SFTs“ bezeichnet einen Vorgang, bei dem die Aufzeichnungen der SFTs vom alten TR auf das neue TR übertragen werden.
- „TR-Teilnehmer“²⁵ bezeichnet eine Stelle, die eine vertragliche Vereinbarung zum Zweck der Meldung von SFT-Kontrakten gemäß Artikel 4 der SFT-Verordnung mit mindestens einem registrierten oder anerkannten TR geschlossen hat. Bei dem

²⁴ <https://eur-lex.europa.eu/legal-content/DE/TXT/?uri=CELEX%3A32017R0104>

²⁵ Mitunter spezifizieren einige TRs die Arten von TR-Teilnehmern näher, z. B. meldende, allgemein meldende, nicht meldende usw. Teilnehmer. Diese Unterkategorien sind im Sinne dieser Leitlinien transparent.

TR-Teilnehmer kann es sich um eine RSE, eine für die Meldung zuständige Stelle, eine meldende Gegenpartei oder eine zentrale Gegenpartei handeln.

3 Zweck

4. Ziel dieser Leitlinien ist es, innerhalb des Europäischen Finanzaufsichtssystems (ESFS) kohärente, effiziente und wirksame Aufsichtspraktiken zu schaffen und eine gemeinsame, einheitliche und kohärente Anwendung sicherzustellen, indem für die Transaktionsregister, die meldenden Gegenparteien und die für die Meldung zuständige Stelle Klarheit darüber geschaffen wird, wie die Einhaltung der folgenden Bestimmungen der SFT-Verordnung zu jedem Zeitpunkt sichergestellt werden kann:
 - a. Artikel 4 Absatz 1 der SFT-Verordnung, der Folgendes vorsieht: „Gegenparteien von Wertpapierfinanzierungsgeschäften melden jedes von ihnen abgeschlossene Wertpapierfinanzierungsgeschäft sowie jede Änderung oder Beendigung eines solchen Geschäfts einem gemäß Artikel 5 registrierten oder gemäß Artikel 19 anerkannten Transaktionsregister. Diese Einzelheiten sind spätestens an dem auf den Abschluss, die Änderung oder die Beendigung des Geschäfts folgenden Arbeitstag zu melden.“
 - b. Artikel 80 Absatz 3 der EMIR, der Folgendes vorsieht: „Ein Transaktionsregister zeichnet umgehend die gemäß Artikel 9 empfangenen Informationen auf und bewahrt sie mindestens für einen Zeitraum von zehn Jahren nach Beendigung der entsprechenden Kontrakte auf. Es wendet effiziente Verfahren zur zeitnahen Aufzeichnung an, um Änderungen der aufgezeichneten Informationen zu dokumentieren.“, worauf in Artikel 5 Absatz 2 der SFT-Verordnung verwiesen wird;
 - c. Artikel 79 Absatz 3 der EMIR, der Folgendes vorsieht: „Ein Transaktionsregister, dessen Registrierung widerrufen wurde, muss für die ordnungsgemäße Ersetzung sorgen, einschließlich des Datentransfers auf andere Transaktionsregister und der Umleitung der Meldungen auf andere Transaktionsregister.“, worauf in Artikel 5 Absatz 2 der SFTR verwiesen wird, sowie
 - d. die Verfahren für die Übertragbarkeit gemäß Artikel 78 Absatz 9 der EMIR, auf die in Artikel 5 Absatz 2 der SFTR verwiesen wird.
5. Die Leitlinien beruhen auf Artikel 16 Absatz 1 der ESMA-Verordnung, der Folgendes vorsieht: „Um innerhalb des ESFS kohärente, effiziente und wirksame Aufsichtspraktiken zu schaffen und eine gemeinsame, einheitliche und kohärente Anwendung des Unionsrechts sicherzustellen, gibt die Behörde Leitlinien für alle zuständigen Behörden beziehungsweise alle Finanzmarktteilnehmer heraus und richtet Empfehlungen an eine oder mehrere zuständige Behörden oder ein oder mehrere Finanzmarktteilnehmer.“

6. Mit den neuen Leitlinien zur Übertragung von Daten gemäß der SFT-Verordnung wird ein dreifacher Zweck verfolgt:
 - a. Beseitigung von Hindernissen für die Übertragbarkeit aus dem wettbewerbsorientierten TR-Umfeld und Gewährleistung, dass die TR-Teilnehmer von dem Umfeld mit mehreren TR profitieren können;
 - b. Sicherstellung der Qualität der für die Behörden verfügbaren Daten, einschließlich der von TRs vorgenommenen Aggregationen, auch in Fällen, in denen der TR-Teilnehmer das TR, an das er meldet, wechselt und ungeachtet der Gründe für einen solchen Wechsel;
 - c. Sicherstellung einer kohärenten und harmonisierten Methode zur Übertragung von Aufzeichnungen von einem TR auf ein anderes und zur Unterstützung der Kontinuität der Meldung und des Abgleichs in allen Fällen, auch im Falle des Widerrufs der Registrierung eines TR.
7. Ein Transfer von Daten auf ein anderes TR kann aus verschiedenen Gründen erforderlich sein. Die Leitlinien befassen sich daher separat mit folgenden Situationen: einerseits solche, in denen i) der Transfer aufgrund des Widerrufs der Registrierung des TR erfolgt, und andererseits Fälle, in denen ii) der Transfer auf freiwilliger Basis und unter normalen Marktbedingungen erfolgt. Die Leitlinien 1 bis 15 sowie die Leitlinien 33 und 34 gelten für beide Situationen; die Leitlinien 16 bis 22 gelten nur für die freiwillige Übertragung und die Leitlinien 23 bis 32 gelten nur für den Widerruf der Registrierung eines Transaktionsregisters. Die Anreize und Beweggründe für die jeweiligen Parteien sind in den beiden Fällen unterschiedlich, weshalb jeweils eine spezifische Herangehensweise erforderlich ist.
8. In den Leitlinien werden Grundsätze auf hoher Ebene festgelegt, die einerseits von den TR-Teilnehmern, z. B. RSE, Gegenparteien und CCPs, und andererseits von den TRs zu befolgen sind. Diese Grundsätze werden durch spezifische Verfahren ergänzt, die die zeitnahe und solide Übertragung von Einzelheiten von SFTs gewährleisten sollen. Diese Leitlinien beziehen sich jedoch nicht auf Situationen, die keinen Datentransfer erfordern, etwa im Zusammenhang mit meldenden Gegenparteien, die sich entschlossen haben, an zwei oder mehrere TRs gleichzeitig zu melden.

4 Einhaltung der Vorschriften und Berichtspflichten

4.1 Status der Leitlinien

9. Gemäß Artikel 16 Absatz 3 der ESMA-Verordnung unternehmen die nationalen zuständigen Behörden, die TR, die meldenden Gegenparteien und die für die Meldung zuständigen Stellen alle erforderlichen Anstrengungen, um diesen Leitlinien nachzukommen.
10. Die hiervon betroffenen zuständigen Behörden sollten diesen Leitlinien nachkommen, indem sie sie ggf. in ihre einzelstaatlichen Rechts- und/oder Aufsichtsrahmen übernehmen; dies gilt auch für jene Leitlinien, die sich in erster Linie an die Finanzmarktteilnehmer richten. In diesem Fall sollten die zuständigen Behörden durch ihre Aufsicht sicherstellen, dass die Finanzmarktteilnehmer den Leitlinien nachkommen.
11. Die ESMA wird die Anwendung dieser Leitlinien durch TR im Rahmen ihrer laufenden direkten Aufsicht beurteilen.

4.2 Berichtspflichten

12. Die zuständigen Behörden, für die diese Leitlinien gelten, müssen die ESMA innerhalb von zwei Monaten ab dem Datum, an welchem die Leitlinien in allen Amtssprachen der EU auf der Website der ESMA veröffentlicht worden sind, darüber informieren, ob sie den Leitlinien (i) nachkommen, (ii) nicht nachkommen, jedoch beabsichtigen, ihnen nachzukommen, oder (iii) nicht nachkommen und nicht beabsichtigen, ihnen nachzukommen.
13. Für den Fall der Nichteinhaltung müssen die zuständigen Behörden der ESMA zudem innerhalb von zwei Monaten ab dem Datum, an welchem die Leitlinien in allen Amtssprachen der EU auf der Website der ESMA veröffentlicht worden sind, die Gründe für die Nichteinhaltung der Leitlinien mitteilen.
14. Eine Vorlage für entsprechende Mitteilungen steht auf der Website der ESMA zur Verfügung. Die ausgefüllte Vorlage ist an die ESMA zu senden.
15. Die TR sind nicht verpflichtet, mitzuteilen, ob sie diesen Leitlinien folgen werden.
16. Meldende Gegenparteien und in ihrem Namen meldende Einrichtungen sind nicht verpflichtet, zu melden, ob sie diesen Leitlinien nachkommen.

5 Leitlinien zum Datentransfer zwischen Transaktionsregistern gemäß der SFT-Verordnung

Leitlinie 1. Nur das alte TR und das neue TR sollten den Transfer von Daten zu SFTs durchführen. Das neue TR sollte keine doppelten Meldungen akzeptieren, die von TR-Teilnehmern im Zusammenhang mit SFTs, die Gegenstand einer Übertragung sind, abgegeben werden. Das alte TR sollte keine Meldungen der Aktionstypen „ETRM“ und „EROR“ akzeptieren, die von TR-Teilnehmern im Zusammenhang mit SFTs, die Gegenstand der Übertragung sind, erstellt wurden.

Leitlinie 2. Der Datentransfer sollte von den TRs entsprechend einem im gegenseitigen Einvernehmen vereinbarten Migrationsplan durchgeführt werden. Der Migrationsplan sollte die detaillierte Planung (Zeitplan) sowie eine Beschreibung der erforderlichen Kontrollen zur Sicherstellung eines rechtzeitigen, vollständigen und exakten Datentransfers enthalten.

Leitlinie 3. Sämtliche TRs sollten eine standardisierte Vorlage eines Migrationsplans verwenden, auf die sich alle TRs einvernehmlich geeinigt haben und die mit den Inhalten der Leitlinie 4 konform ist.

Leitlinie 4. Der Migrationsplan sollte folgende Angaben enthalten:

- (i) den Umfang des Datentransfers (z. B. der/die TR-Teilnehmer, beteiligte SFTs usw.);
- (ii) detaillierte Regelungen bezüglich der Aufgaben und Zuständigkeiten der beteiligten Einrichtungen;
- (iii) den Zeitplan und entsprechende Meilensteine für den Transfer;
- (iv) die für die Gewährleistung der Vertraulichkeit der übertragenen Daten erforderliche Kontrollen (z. B. Art der verwendeten Verschlüsselung);
- (v) die für die Gewährleistung der Integrität und Richtigkeit der übertragenen Daten erforderliche Kontrollen (z. B. kryptografische Prüfsummen und Hashing-Algorithmen);
- (vi) die für die Gewährleistung der Betriebskontinuität erforderliche Kontrollen und den Status des Abgleichs zwischen TRs bezüglich der SFTs, die Gegenstand einer Übertragung sind;
- (vii) Annahmeschluss und Datenverfügbarkeit sowie
- (viii) sonstige Informationen, die den reibungslosen Datentransfer erleichtern und sicherstellen.

Leitlinie 5. Die Transaktionsregister sollten einander Daten unter Verwendung des XML-Formats und der Vorlage übertragen, die in Artikel 4 der RTS für den Zugang zu Daten festgelegt sind. Ungeachtet dessen können die TR im Falle von i) SFTs, die zum Zeitpunkt des Transfers nicht ausstehen, oder iii) zurückgewiesenen SFTs CSV-Dateien (kommagetrennte Werte) verwenden. In die Dateien, die übertragen werden, sollte das alte

TR alle relevanten Einzelheiten zu den SFTs, die Gegenstand der Übertragung sind, aufnehmen.

Leitlinie 6. Die TRs sollten für den gegenseitigen Datentransfer sichere Machine-to-Machine-Protokolle verwenden, unter anderem das SSH File Transfer Protocol.

Leitlinie 7. Die TRs sollten erweiterte Verschlüsselungsprotokolle verwenden und die jeweiligen öffentlichen Verschlüsselungsschlüssel untereinander austauschen. Um ein reibungsloses Funktionieren der Datenverschlüsselung sicherzustellen, sollten die TRs im Voraus testen, ob sie in der Lage sind, die Dateien des jeweils anderen zu ver- und entschlüsseln.

Leitlinie 8. Das alte TR sollte die Zahl der SFTs und die Zahl der dazugehörigen Lebenszyklusereignisse, die auf das neue TR übertragen werden, berechnen. Das alte TR sollte den TR-Teilnehmer um Abzeichnung der Zahlen bezüglich der ausstehenden SFTs ersuchen und sämtliche Unstimmigkeiten frühestmöglich, spätestens jedoch binnen fünf Arbeitstagen beseitigen.

Leitlinie 9. Für jede generierte und übertragene Datei sollte das alte TR eine kryptografische Prüfsumme entsprechend einem einvernehmlich vereinbarten Hash-Algorithmus generieren und in den Datentransfer aufnehmen.

Leitlinie 10. Der Transfer von Daten auf Ersuchen eines TR-Teilnehmers sollte grundsätzlich an einem arbeitsfreien Tag vorgenommen werden. Das alte und das neue TR können jedoch in Abhängigkeit des erwarteten Umfangs des Transfers vereinbaren, den Transfer an einem Arbeitstag vorzunehmen.

Leitlinie 11. Die TR sollten sicherstellen, dass die TR-Teilnehmer vor dem Datentransfer an einem arbeitsfreien Tag die ausstehenden SFTs, die Gegenstand des Datentransfers sind, ändern, um der aktuellsten Meldepflicht spätestens am Freitag vor dem Wochenende, an dem die Übertragung stattfindet, bis 23:59:59 Uhr nachzukommen, und

- (i) im Falle der vollständigen Übertragung sollte das alte TR ab dem Beginn des Datentransfers keine Meldungen über Lebenszyklusereignisse und Positionsdaten in Bezug auf die SFTs, die Gegenstand der Übertragung sind, akzeptieren,
- (ii) und darüber hinaus sollte der TR-Teilnehmer im Falle einer teilweisen Übertragung sicherstellen, dass die Lebenszyklusereignisse im Zusammenhang mit den SFTs den betreffenden TRs genau gemeldet werden.

Bei Übertragungen an Arbeitstagen müssen sich das alte TR und das neue TR vor dem Datentransfer auf einen Zeitpunkt einigen, bis zu dem die Änderungen der ausstehenden SFTs, die Gegenstand des Datentransfers sind, vom TR-Teilnehmer abgeschlossen werden sollten. Bei Übertragungen an Arbeitstagen sollten die Ziffern i und ii von dem alten TR und dem TR-Teilnehmer befolgt werden.

Leitlinie 12. Bis die Übertragung aller relevanten Dateien, die Gegenstand der Übertragung sind, abgeschlossen ist, sollte das neue TR keine Lebenszykluseignisse und Positionsdaten bezüglich der SFTs, die Gegenstand der Übertragung sind, akzeptieren. Das alte TR sollte die Daten zu ausstehenden SFTs den zuständigen Behörden zur Verfügung stellen.

Leitlinie 13. Sobald der Datentransfer abgeschlossen ist, sollte das neue TR:

- (i) die Daten den Behörden zur Verfügung stellen,
- (ii) die Daten, die Gegenstand der Übertragung sind, in die einschlägigen öffentlichen und die nur für die Behörden bestimmten Aggregationen aufnehmen,
- (iii) die Daten gegebenenfalls in das Verfahren zum Abgleich zwischen TRs aufnehmen.

Leitlinie 14. Nach der Übertragung von Aufzeichnungen von einem TR-Teilnehmer in ein anderes TR sollte das alte TR keine spezifischen Gebühren für die Aufzeichnung von nicht ausstehenden SFTs erheben.

Leitlinie 15. Für den Fall, dass nicht alle im Migrationsplan erfassten Daten auf einmal übertragen werden können, sollten die TRs die Daten in folgender Reihenfolge übertragen:

- (i) den letzten Stand der erhaltenen ausstehenden SFTs, d. h. den „Handelsstand“;
- (ii) im Falle des Widerrufs der Registrierung die Meldungen zu Lebenszykluseignissen, die für die ausstehenden SFTs anwendbar sind;
- (iii) im Falle des Widerrufs der Registrierung alle beendeten und fälligen SFTs, die weiterhin der Anforderung gemäß Artikel 80 Absatz 3 der EMIR unterliegen (Querverweis gemäß Artikel 5 Absatz 2 der SFTR), zusammen mit den relevanten Lebenszykluseignissen;
- (iv) im Falle des Widerrufs der Registrierung alle fehlerhaften SFTs, die weiterhin der Anforderung gemäß Artikel 80 Absatz 3 der EMIR unterliegen, gemäß dem Verweis in Artikel 5 Absatz 2 der SFT-Verordnung, zusammen mit den relevanten Lebenszykluseignissen;
- (v) im Falle eines Widerrufs der Registrierung alle abgelehnten, vom TR-Teilnehmer gemeldeten SFTs, die die Datenvalidierungen nicht bestanden haben;
- (vi) im Falle eines Widerrufs der Registrierung das Meldeprotokoll des alten TR in einem maschinenlesbaren Format, das den Grund oder die Gründe für eine Änderung, das Datum, den Zeitstempel und eine klare Beschreibung der Änderungen (einschließlich des alten und neuen Inhalts der relevanten Daten) in Bezug auf die übertragenen SFTs aufzeichnet; und
- (vii) im Falle des Widerrufs der Registrierung alle Daten über Ablehnungen, d. h. die Berichte für die Behörden, die die Zurückweisungen betreffen, im XML-Format, und alle Daten zum Abgleich, d. h. die Berichte für die Behörden im XML-Format in Bezug auf den Abgleichsstatus.

Leitlinie 16. Im Falle eines Datentransfers auf Ersuchen eines TR-Teilnehmers sollte das alte TR festlegen, ob alle oder einige der SFTs betreffend Gegenparteien, die nicht meldende TR-Teilnehmer sind und die von dem TR-Teilnehmer gemeldet wurden, an das neue TR übertragen werden sollten.

Leitlinie 17. Beschließt im Falle eines Datentransfers auf Ersuchen eines TR-Teilnehmers ein nicht meldender TR-Teilnehmer, beim alten TR zu bleiben, obwohl sein meldender TR-Teilnehmer um einen Transfer an ein anderes TR ersucht hat, sollte das alte TR die im Namen des nicht meldenden TR-Teilnehmers vorgelegten SFTs von den SFTs, die übertragen werden, abziehen.

Leitlinie 18. Im Falle eines Datentransfers auf Ersuchen eines TR-Teilnehmers und wenn die Registrierung des alten TR weder widerrufen wird noch das Verfahren zum Widerruf läuft, ist nur der letzte Stand der ausstehenden SFTs, d. h. der „Handelsstand“, zu übertragen.

Leitlinie 19. Im Falle eines Datentransfers auf Ersuchen eines TR-Teilnehmers sollten das alte und das neue TR das in Anhang I beschriebene Verfahren für den Datentransfer auf Ersuchen eines TR-Teilnehmers gemäß der SFTR-Verordnung befolgen. Die TRs sollten sich so bald wie möglich, spätestens jedoch binnen zehn Arbeitstagen nach Eingang des entsprechenden Ersuchens auf einen Migrationsplan für den Datentransfer eines TR-Teilnehmers einigen.

Leitlinie 20. Im Falle eines Datentransfers auf Ersuchen eines TR-Teilnehmers sollte das neue TR, sobald die ausstehenden SFTs eines TR-Teilnehmers auf das neue TR übertragen werden, dies dem TR-Teilnehmer, dem alten TR, den übrigen TRs und den zuständigen Behörden, die auf die vom TR-Teilnehmer gemeldeten SFTs zugreifen, bestätigen.

Leitlinie 21. Im Falle eines Datentransfers auf Ersuchen eines TR-Teilnehmers sollte das alte TR die übertragenen Daten isolieren und sicher aufbewahren, indem es auf die übertragenen Daten für mindestens drei Monate dieselben Strategien, Verfahren und Schutzmaßnahmen bezüglich der Aufzeichnung anwendet wie auf die übrigen Daten zu SFTs, die ihm gemeldet wurden. Zudem sollte das alte TR den Abruf der Daten binnen höchstens sieben Kalendertagen sicherstellen.

Leitlinie 22. Im Falle eines Datentransfers auf Ersuchen eines TR-Teilnehmers sollten sämtliche Gebühren, die vom alten oder neuen TR erhoben werden, kostenbezogen, diskriminierungsfrei und im Gebührenverzeichnis der jeweiligen TRs, das veröffentlicht wird, aufgeführt sein.

Leitlinie 23. Im Falle des Widerrufs der Registrierung eines TR sollte der Datentransfer alle Einzelheiten zu den dem TR gemeldeten SFTs, einschließlich der zurückgewiesenen, zusammen mit dem entsprechenden Meldeprotokoll und allen Daten über Zurückweisungen umfassen, d. h. die Berichte für die Behörden, die die Zurückweisungen betreffen, im XML-Format, und alle Daten über den Abgleich, d. h. die Berichte für die Behörden in Bezug auf den Abstimmungsstatus, im XML-Format. Die in Leitlinie 15 beschriebene Reihenfolge der Datenübertragung sollte eingehalten werden.

Leitlinie 24. Im Falle des Widerrufs der Registrierung eines TR sollte(n) der(die) Migrationsplan(pläne) für den Datentransfer in den vom TR vorgestellten Abwicklungsplan aufgenommen werden.

Leitlinie 25. Steht der Datentransfer im Zusammenhang mit dem Widerruf der Registrierung eines TR, sollte das alte TR und das neue TR das in Anhang II enthaltene Verfahren für die

Migration im Falle des Widerrufs der Registrierung gemäß der SFT-Verordnung befolgen. Die in Leitlinie 15 beschriebene Reihenfolge der Datenübertragung sollte eingehalten werden. Das alte TR, d. h. das TR, dessen Registrierung widerrufen werden soll, sollte der ESMA ausreichend Belege dafür vorlegen, dass sämtliche Transfers erfolgreich waren.

Leitlinie 26. Im Falle eines Widerrufs der Registrierung auf Ersuchen eines TR sollte es die ESMA im Voraus über das beabsichtigte Datum der Einstellung des Geschäftsbetriebs informieren und anschließend unverzüglich die TR-Teilnehmer, die anderen TR und die betreffenden nationalen zuständigen Behörden auf elektronischem Wege benachrichtigen. Bei TR mit mehr als 500 TR-Teilnehmern sollte die Frist für die Vorankündigung mindestens neun Monate betragen, bei TR mit 500 oder weniger als 500 TR-Teilnehmern mindestens sechs Monate.

Leitlinie 27. Im Falle des Widerrufs der Registrierung sollte das neue TR nach Abschluss des/der Transfers den TR-Teilnehmern dies allen übrigen TRs sowie den jeweiligen nationalen zuständigen Behörden bestätigen.

Leitlinie 28. Im Falle des Widerrufs der Registrierung sollte das alte TR die übertragenen Daten isolieren und sicher aufbewahren, indem es auf die übertragenen Daten bis zum Zeitpunkt der tatsächlichen Einstellung des Betriebs dieselben Strategien, Verfahren und Schutzmaßnahmen bezüglich der Aufzeichnung anwendet wie auf die übrigen Daten. Zudem sollte das alte TR den rechtzeitigen Abruf der Daten binnen höchstens sieben Kalendertagen sicherstellen. Zum Zeitpunkt der tatsächlichen Einstellung des Betriebs sollte das alte TR eine sichere Vernichtung/Löschung nach bestmöglichen Methoden und den zuverlässigsten verfügbaren Techniken vornehmen, um sicherzustellen, dass die Löschung von Daten nach diesem Zeitpunkt nicht rückgängig gemacht werden kann bzw. dass die Daten nicht wiederhergestellt werden können.

Leitlinie 29. Im Falle des Widerrufs der Registrierung sollte keines der TRs Gebühren für den Transfer von Daten erheben.

Leitlinie 30. Im Falle eines Widerrufs der Registrierung kann das neue TR den aktiven TR-Teilnehmern Gebühren für ihre nicht ausstehenden SFT-Daten in Rechnung stellen.

Leitlinie 31. Im Falle eines Widerrufs der Registrierung kann das neue TR nicht ausstehende SFT-Daten unterschiedlicher Datenqualität und/oder solche, die in unterschiedlichen Formaten vorliegen, in verschiedenen Datenbanken/Tabellen speichern. Das neue TR sollte auf Anfrage Anfragen von Behörden beantworten.

Leitlinie 32. Im Falle eines Widerrufs der Registrierung sollte das TR, dessen Registrierung widerrufen wird, dem neuen TR die erforderlichen technischen Informationen über die zu übertragenden Daten zur Verfügung stellen, um den Datentransfer an das neue TR und die anschließende Speicherung durch das neue TR zu erleichtern. Das alte TR sollte dem neuen TR die zuvor genannten Informationen rechtzeitig zur Verfügung stellen, damit sich das neue TR bei Bedarf vorbereiten kann. Die technische Dokumentation sollte mindestens die folgenden Aspekte umfassen:

- (i) Zuordnung der Felder zu den SFTR-Feldern und

(ii) technische Erläuterungen für jedes Feld.

Leitlinie 33. Vor und nach der Übertragung der Aufzeichnungen eines TR-Teilnehmers sollte der TR-Teilnehmer mit dem neuen und dem alten TR die Richtigkeit der folgenden aggregierten Informationen in Bezug auf die SFTs, die Gegenstand der Übertragung sind, in Übereinstimmung mit dem in Leitlinie 11 dargelegten Zeitplan überprüfen und bestätigen:

(i) die Gesamtzahl der ausstehenden SFTs, wobei jedes SFT durch die eindeutige Kombination der Felder „Meldende Gegenpartei“, „Andere Gegenpartei“ und „Eindeutige Transaktionskennung“ identifiziert wird, zusammen mit den entsprechenden Meldungen von Sicherheiten auf Nettobasis, Einschussmeldungen und Weiterverwendungsmeldungen;

(ii) die Gesamtzahl der Meldungen in Bezug auf Lebenszyklusevents dieser SFTs für Meldungen zu Geschäften, Einschuss- und Weiterverwendungsmeldungen (falls diese übertragen werden), wobei Folgendes gilt:

- jede Meldung von Darlehen und Sicherheiten wird durch die eindeutige Kombination der SFT-Felder „Meldende Gegenpartei“, „Andere Gegenpartei“, „Eindeutige Transaktionskennung“ oder „Art des Rahmenvertrags“ identifiziert;
- jede Einschussmeldung wird durch die eindeutige Kombination der SFT-Felder „Meldende Gegenpartei“, „Andere Gegenpartei“ und „Portfoliocode“ gekennzeichnet;
- jede Wiederverwendungsmeldung wird durch die eindeutige Kombination der SFT-Felder „Meldende Gegenpartei“ und „Für die Meldung zuständige Stelle“ gekennzeichnet;

(iii) die Gesamtzahl der Aufzeichnungen in Bezug auf beendete und fällige SFTs für Meldungen über Darlehen und Sicherheiten, Einschusszahlungen und Weiterverwendungen in den letzten fünf Jahren, für die eine Aufzeichnungspflicht gemäß Artikel 4 Absatz 4 SFT-Verordnung besteht (im Falle einer Übertragung);

(iv) die Gesamtzahl der Aufzeichnungen im Zusammenhang mit fehlerhaften SFTs für Meldungen über Darlehen und Sicherheiten, Einschuss- und Weiterverwendungsmeldungen in den letzten fünf Jahren, für die gemäß Artikel 4 Absatz 4 SFT-Verordnung Aufzeichnungspflichten bestehen (falls diese übertragen werden).

Leitlinie 34. Gemäß Leitlinie 58 der Leitlinien für die Meldung gemäß Artikel 4 und 12 der SFT-Verordnung gilt Folgendes: Melden eine FC und eine KMU-NFC an zwei verschiedene TRs ausstehende SFTs, die Gegenstand der Übertragung sind:

(i) Beschließt die KMU-NFC, nicht selbst zu melden, sollten die ausstehenden SFTs der KMU-NFC an das TR der FC übertragen werden, es sei denn, die FC beschließt, Kunde des TR der KMU-NFC zu werden, und meldet die mit der KMU-NFC geschlossenen SFTs an dieses TR.

(ii) Wenn eine NFC ihren Status von einer Nicht-KMU-NFC zu einer KMU-NFC ändert und beschließt, ihre SFTs nicht selbst zu melden, sollte sie ihre ausstehenden SFTs, die mit der FC abgeschlossen wurden, zum Zeitpunkt der Statusänderung auf das TR dieser FC übertragen, es sei denn, die FC beschließt, Kunde des TR der KMU-NFC zu werden und die

mit der KMU-NFC geschlossenen SFTs an dieses TR zu melden. Ebenso sollten bei jeder Änderung des Status einer NFC von einer KMU-NFC zu einer Nicht-KMU-NFC die ausstehenden, mit der FC abgeschlossenen SFTs an das TR der NFC zurückübertragen werden, es sei denn, die NFC beschließt, Kunde des TR der FC zu werden und die mit der FC abgeschlossenen SFTs an dieses TR zu melden.

(iii) Für die Durchführung des Datentransfers wird weder von der nichtfinanziellen Gegenpartei noch von der finanziellen Gegenpartei (oder einer die Meldung einreichenden Stelle, die die Meldung in ihrem Namen vornimmt) erwartet, dass sie bei dem Transaktionsregister der anderen Gegenpartei verbleiben.

5.1 Anhang I – Verfahren für den Datentransfer auf Ersuchen eines TR-Teilnehmers gemäß der SFT-Verordnung

<p>A. Planung und Vorbereitung</p> <p>Nach Unterzeichnung der einschlägigen vertraglichen Vereinbarung mit dem TR-Teilnehmer übermittelt das neue TR dem alten TR den gemäß Leitlinie 3 erstellten Migrationsplan und einigt sich mit diesem darauf.</p> <p>Das neue TR setzt die zuständigen Behörden per E-Mail über den Transfer in Kenntnis.</p> <p>Das alte TR legt mit dem TR-Teilnehmer die folgenden aggregierten Informationen bezüglich der Derivate des TR-Teilnehmers, die Gegenstand der Übertragung sind, fest und einigt sich mit diesem darauf:</p> <ul style="list-style-type: none"> ○ Der aktuelle Stand der erhaltenen ausstehenden SFTs, d. h. der „Handelsstand“ ○ Gesamtzahl der ausstehenden SFTs <p>Das alte TR sollte den TR-Teilnehmer gemäß Leitlinie 8 um eine Bestätigung der Richtigkeit der oben genannten Informationen gegenüber den eigenen Aufzeichnungen des TR-Teilnehmers²⁶ ersuchen. Im Falle einer Unstimmigkeit sollte das alte TR die entsprechenden Zahlen mit dem TR-Teilnehmer abgleichen und sich mit ihm auf die endgültige Liste der SFT-Meldungen einigen, die migriert werden. Das alte TR sollte sämtliche Unstimmigkeiten <i>frühestmöglich, spätestens jedoch binnen fünf Arbeitstagen</i> beseitigen.</p>
<p>B. Ausführung des Transfers</p> <p>Sobald die Anzahl der SFTs und Aufzeichnungen bestätigt ist, sollte das alte TR mit der Generierung der relevanten Datei(en) gemäß Leitlinie 5 und den einschlägigen allgemeinen Grundsätzen fortfahren.</p> <p>Das alte und das neue TR führen den Migrationsplan aus. Das alte TR sollte die generierten Dateien auf das neue TR übertragen, das die Dateiübertragung bestätigt.</p> <p>In diesem Zusammenhang sollten die ausstehenden SFTs innerhalb eines vorab festgelegten Wochenendes oder an einem vereinbarten Arbeitstag übertragen werden.</p>
<p>C. Überprüfung der übertragenen Daten</p> <p>Das neue TR sollte die folgenden Zahlen und Informationen für die erhaltenen Aufzeichnungen bestimmen und die Vollständigkeit der Übertragung überprüfen:</p>

²⁶ Artikel 4 Absatz 4 SFT-Verordnung sieht Folgendes vor: „Gegenparteien bewahren die Aufzeichnungen für von ihnen abgeschlossene, geänderte oder beendete Wertpapierfinanzierungsgeschäfte mindestens fünf Jahre nach Beendigung des Geschäfts auf.“ Falls ein meldender TR-Teilnehmer im Namen anderer meldet, sollte er auch deren Aufzeichnungen heranziehen.

<ul style="list-style-type: none"> ○ Der aktuelle Stand der erhaltenen ausstehenden SFTs, d. h. der „Handelsstand“ ○ Gesamtzahl der ausstehenden SFTs
<p>Das neue TR sollte den TR-Teilnehmer gemäß Leitlinie 33 um eine Bestätigung der Richtigkeit der oben genannten Informationen gegenüber den eigenen Aufzeichnungen des TR-Teilnehmers ersuchen²⁷. Im Falle einer Unstimmigkeit sollten die beiden TRs versuchen, die entsprechenden Zahlen mit dem TR-Teilnehmer abzugleichen, bis eine Einigung erzielt wird.</p>
<p>D. Abschließende Mitteilungen</p>
<p>Das neue TR sollte alle TRs darüber in Kenntnis setzen, dass der meldende Teilnehmer zu ihm gewechselt ist. Diese Informationen sollten dazu dienen, das Verfahren zum Abgleich für die einschlägigen SFTs, die in das neue TR migriert wurden, zu erleichtern.</p>
<p>Das neue TR sollte die einschlägige(n) zuständige(n) nationale(n) Behörde(n) und die ESMA über den Abschluss des Transfers der Daten des TR-Teilnehmers unterrichten und die Arten der betroffenen SFTs identifizieren.</p>
<p>E. Aufzeichnung und sichere Datenlöschung</p>
<p>Das alte TR sollte die migrierten ausstehenden SFTs aus allen Datenaggregationen entfernen.</p>
<p>Das alte TR sollte die übertragenen Daten so lange, wie durch die allgemeinen Grundsätze vorgeschrieben, und gemäß den vor dem Transfer geltenden Anforderungen der SFT-Verordnung aufbewahren.</p>
<p>Das alte TR sollte das Meldelogsbuch mindestens 10 Jahre lang nach der Kündigung der entsprechenden Verträge aufbewahren.</p>
<p>Das alte TR wird die übertragenen Daten vernichten/löschen, sobald dies nach den einschlägigen allgemeinen Grundsätzen für eine sichere Löschung/Vernichtung gestattet ist.</p>

²⁷ Artikel 4 Absatz 4 SFT-Verordnung sieht Folgendes vor: „Gegenparteien bewahren die Aufzeichnungen für von ihnen abgeschlossene, geänderte oder beendete Wertpapierfinanzierungsgeschäfte mindestens fünf Jahre nach Beendigung des Geschäfts auf.“ Falls ein meldender TR-Teilnehmer im Namen anderer meldet, sollte er auch deren Aufzeichnungen heranziehen.

5.2 Anhang II – Migrationsverfahren im Falle des Widerrufs der Registrierung gemäß der SFTR

<p>A. Anfängliche Mitteilungen</p> <p>(Freiwilliger Widerruf) Das TR unterrichtet die ESMA, die TR-Teilnehmer, sonstige beteiligte TRs und die nationalen zuständigen Behörden spätestens (gemäß Leitlinie 26) vor dem beabsichtigten Datum der Einstellung des Betriebs über sein Ersuchen um Widerruf seiner Registrierung (falls der Widerruf von dem TR beantragt wird).</p> <p>oder</p> <p>(Unfreiwilliger Widerruf) Die ESMA unterrichtet das(die) neue(n) TR(s) und die nationalen zuständigen Behörden darüber, dass das(die) neue(n) TR(s) Daten erhalten sollte(n), die ursprünglich dem alten TR gemeldet wurden (falls der Widerruf nicht von dem TR beantragt wird).</p>
<p>B. Planung und Vorbereitung</p> <p>Das alte TR informiert die TR-Teilnehmer über seine Absicht, den Betrieb einzustellen. Das(die) TR(s) erstellt(erstellen) den in Leitlinie 3 beschriebenen Migrationsplan und übermittelt(übermitteln) ihn der ESMA und dem(den) neuen TR(s). Die ESMA und die übrigen beteiligten TRs äußern mögliche Einwände oder Bedenken. Sobald diese ausgeräumt sind, einigen sich alle Parteien auf die Einzelheiten des Migrationsplans.</p> <p>Das alte TR identifiziert die SFTs, die Gegenstand der Übertragung sind, und übermittelt der ESMA und den übrigen beteiligten TRs (im Rahmen des Migrationsplans oder separat) die folgenden Informationen bezüglich der SFTs, die Gegenstand der Übertragung je TR sind:</p> <ul style="list-style-type: none"> ○ Der aktuelle Stand der erhaltenen ausstehenden SFTs, d. h. der „Handelsstand“ ○ Gesamtzahl der ausstehenden SFTs ○ Gesamtzahl der Aufzeichnungen in Bezug auf Lebenszyklusereignisse, die diesen SFTs entsprechen, für Meldungen über Geschäfte, Einschuss- und Weiterverwendungsmeldungen ○ Gesamtzahl der Aufzeichnungen in Bezug auf beendete und fällige SFTs ○ Gesamtzahl der Aufzeichnungen im Zusammenhang mit fehlerhaften SFTs ○ Gesamtzahl der Aufzeichnungen im Zusammenhang mit abgelehnten, vom TR-Teilnehmer gemeldeten SFTs, die die Datenvalidierung nicht bestanden haben ○ die Anzahl der Einträge im Meldelogsbuch ○ die Gesamtzahl der Meldungen im XML-Format zu Zurückweisungen, die an Behörden weitergeleitet werden, und die Anzahl der Meldungen an Behörden im XML-Format, die den Abstimmungsstatus betreffen
<p>C. Ausführung des Transfers</p> <p>Sobald die Anzahl der SFTs und Aufzeichnungen bestätigt ist, sollte das alte TR mit der Generierung der relevanten Datei(en) gemäß Leitlinie 5 fortfahren.</p>

Das alte TR und das(die) neue(n) TR(s) führen den Migrationsplan aus. Die generierten Daten werden vom alten TR auf das(die) neue(n) TR(s) übertragen, das(die) jede Übertragung bestätigt(bestätigen).

Die Priorisierung der Reihenfolge der SFTs und der in Leitlinie 15 enthaltenen Aufzeichnungen wird eingehalten.

Falls möglich, sollten ausstehende SFTs während und innerhalb eines Wochenendes oder an einem vereinbarten Arbeitstag übertragen werden, wobei die entsprechenden Lebenszyklusereignisse für die Meldung von Geschäften, Einschuss- und Weiterverwendungsmeldungen so bald wie möglich übermittelt werden sollten.

Falls dies nicht möglich ist, sollten die ausstehenden SFTs je TR-Teilnehmer in zwei oder mehr Chargen unterteilt werden, die an aufeinanderfolgenden Wochenenden oder vereinbarten Arbeitstagen übertragen werden. Die entsprechenden Lebenszyklusereignisse je Charge sollten zum frühestmöglichen Zeitpunkt übertragen werden.

Die verbleibenden SFTs sollten so bald wie möglich übertragen werden.

Mögliche Probleme, die ermittelt werden, sowie die erzielten Fortschritte werden der ESMA rechtzeitig gemeldet.

D. Prüfung des Datentransfers

Das(die) neue(n) TR(s) sollte(n) die folgenden Zahlen und Informationen für die erhaltenen Aufzeichnungen bestimmen und die Vollständigkeit der Übertragung überprüfen:

- Der aktuelle Stand der erhaltenen ausstehenden SFTs, d. h. der „Handelsstand“
- Gesamtzahl der ausstehenden SFTs
- Gesamtzahl der Aufzeichnungen in Bezug auf Lebenszyklusereignisse, die diesen SFTs entsprechen, für Meldungen über Geschäfte, Einschuss- und Weiterverwendungsmeldungen
- Gesamtzahl der Aufzeichnungen in Bezug auf beendete und fällige SFTs
- Gesamtzahl der Aufzeichnungen im Zusammenhang mit fehlerhaften SFTs
- Gesamtzahl der Aufzeichnungen im Zusammenhang mit abgelehnten, vom TR-Teilnehmer gemeldeten SFTs, die die Datenvalidierung nicht bestanden haben
- die Anzahl der Einträge im Meldeloggbuch
- die Gesamtzahl der Meldungen im XML-Format zu Zurückweisungen, die an Behörden weitergeleitet werden, und die Anzahl der Meldungen an Behörden im XML-Format, die den Abstimmungsstatus betreffen

Die neuen TRs sollten die ESMA und das alte TR über das Ergebnis der Prüfung unterrichten. Sollte die Überprüfung fehlschlagen, wird die Ursache von beiden Parteien (altes und neues TR) untersucht, und der Übertragungsprozess sollte so lange wiederholt werden, bis der Datentransfer erfolgreich ist.

E. Abschließende Mitteilungen

Die neuen TRs sollten die relevanten TR-Teilnehmer, alle verbleibenden TRs und die jeweiligen nationalen zuständigen Behörden (per E-Mail) über den erfolgreichen Abschluss der Übertragung in Kenntnis setzen.

F. Aufzeichnung und sichere Datenlöschung
--

Das alte TR sollte die übertragenen Daten so lange, wie in Leitlinie 28 angegeben, und gemäß den vor dem Transfer geltenden SFTR-Anforderungen aufbewahren.

Das alte TR sollte die übertragenen Daten, sobald dies gestattet ist, und entsprechend den einschlägigen Grundsätzen von Leitlinie 28 für eine sichere Löschung/Vernichtung vernichten/löschen.
