

II

(Rechtsakte ohne Gesetzescharakter)

VERORDNUNGEN

DURCHFÜHRUNGSVERORDNUNG (EU) 2016/378 DER KOMMISSION

vom 11. März 2016

zur Festlegung technischer Durchführungsstandards in Bezug auf den Zeitplan, das Format und Muster für die Übermittlung der Meldungen an die zuständigen Behörden gemäß Verordnung (EU) Nr. 596/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates

(Text von Bedeutung für den EWR)

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Verordnung (EU) Nr. 596/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 16. April 2014 über Marktmissbrauch (Marktmissbrauchsverordnung) und zur Aufhebung der Richtlinie 2003/6/EG des Europäischen Parlaments und des Rates und der Richtlinien 2003/124/EG, 2003/125/EG und 2004/72/EG der Kommission⁽¹⁾, insbesondere auf Artikel 4 Absatz 5 Unterabsatz 3,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Zur Gewährleistung kohärenter Meldepflichten und zur Verringerung des Verwaltungsaufwands der von diesen Pflichten betroffenen Unternehmen ist eine Angleichung der Meldepflichten erforderlich, die sich aus der vorliegenden Verordnung und aus der Delegierten Verordnung der Kommission ergeben, die gemäß Artikel 27 Absatz 3 Unterabsatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates⁽²⁾ zu erlassen ist.
- (2) Damit die zuständigen Behörden und die Europäische Wertpapieraufsichtsbehörde (ESMA) Datenqualität und eine wirksame Marktüberwachung sicherstellen können, sollten die zuständigen Behörden und die ESMA im Interesse der Marktintegrität unverzüglich vollständige Mitteilungen zu jedem Handelstag erhalten.
- (3) Um eine effektive und effiziente Nutzung der Daten durch die zuständigen Behörden zu ermöglichen, sollten für die Übermittlung der Meldungen zu den Finanzinstrumenten einheitliche Muster und Formate verwendet werden. Zu diesem Zweck sollten die internationalen Normen eingehalten werden, die für die Detailangaben in diesen Meldungen gelten.
- (4) Diese Verordnung stützt sich auf den Entwurf technischer Durchführungsstandards, der der Kommission von der ESMA vorgelegt wurde.
- (5) Die ESMA hat zu diesem Entwurf offene öffentliche Konsultationen durchgeführt, hat die damit verbundenen potenziellen Kosten und Nutzeneffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates⁽³⁾ eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt.
- (6) Zur Sicherung reibungslos funktionierender Finanzmärkte sollte diese Verordnung baldmöglichst in Kraft treten und sollten die darin festgelegten Bestimmungen ab demselben Zeitpunkt gelten wie die Bestimmungen der Verordnung (EU) Nr. 596/2014 —

⁽¹⁾ ABl. L 173 vom 12.6.2014, S. 1.

⁽²⁾ Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 15. Mai 2014 über Märkte für Finanzinstrumente und zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (ABl. L 173 vom 12.6.2014, S. 84).

⁽³⁾ 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 (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84).

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

Artikel 1

1. Ein Handelsplatz meldet der für ihn zuständigen Behörde gemäß Artikel 4 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 596/2014 an jedem Handelstag bis spätestens 21.00 Uhr MEZ mithilfe automatisierter Prozesse alle Finanzinstrumente, die auf diesem Handelsplatz vor 18.00 Uhr MEZ an dem betreffenden Tag erstmals Gegenstand eines Antrags auf Zulassung zum Handel waren oder zum Handel zugelassen oder gehandelt wurden (einschließlich der über sein System eingegangenen Aufträge oder Offerten) bzw. deren Handel eingestellt wurde oder deren Zulassung zum Handel auf diesem Handelsplatz erloschen ist.

2. Der Handelsplatz meldet die Finanzinstrumente, die nach 18.00 Uhr MEZ auf diesem Handelsplatz erstmals Gegenstand eines Antrags auf Zulassung zum Handel waren oder zum Handel zugelassen oder erstmals gehandelt wurden (einschließlich der über sein System eingegangenen Aufträge oder Offerten) bzw. deren Handel eingestellt wurde oder deren Zulassung zum Handel an diesem Handelsplatz erloschen ist, bis spätestens 21.00 Uhr MEZ des nächsten Handelstags mithilfe automatisierter Prozesse an die zuständige Behörde.

3. Die zuständigen Behörden übermitteln der ESMA die in Absatz 1 und 2 genannten Meldungen nach Artikel 4 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 596/2014 täglich bis spätestens 23.59 Uhr MEZ mithilfe automatisierter Verfahren und über sichere elektronische Kommunikationskanäle zwischen ihnen und der ESMA.

Artikel 2

Alle Detailangaben, die die Meldungen gemäß Artikel 4 Absatz 1 und 2 der Verordnung (EU) Nr. 596/2014 enthalten müssen, sind in dem im Anhang dieser Verordnung angegebenen Format und nach den dort genannten Normen in elektronischer und maschinenlesbarer Form sowie in einer einheitlichen XML-Vorlage nach der Methodik von ISO 20022 zu übermitteln.

Artikel 3

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

Sie gilt ab dem 3. Juli 2016.

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

Brüssel, den 11. März 2016

Für die Kommission
Der Präsident
Jean-Claude JUNCKER

ANHANG

**Normen und Format für die Übermittlung der Meldungen an die zuständigen Behörden gemäß
Verordnung (EU) Nr. 596/2014**

Tabelle 1

Legende zu Tabelle 3

SYMBOL	DATENTYP	DEFINITION
{ALPHANUM-n}	Bis zu n alphanumerische Zeichen	Freitextfeld
{CFI_CODE}	6 Zeichen	ISO 10962 (CFI-Code).
{COUNTRYCODE_2}	2 alphanumerische Zeichen	Ländercode aus 2 Buchstaben gemäß ISO 3166-1 Alpha-2-Ländercode.
{CURRENCYCODE_3}	3 alphanumerische Zeichen	Ländercode aus 3 Buchstaben gemäß den Währungs_codes nach ISO 4217
{DATE_TIME_FORMAT}	Datums- und Zeitformat gemäß ISO 8601	<ul style="list-style-type: none"> — Datum und Zeit in folgendem Format: — JJJJ-MM-TTThh:mm:ss.ffffffZ. — „JJJJ“: Jahr — „MM“: Monat — „TT“: Tag — „T“: Trenner von Datum und Uhrzeit (time) — „hh“: Stunde — „mm“: Minute — „ss.ffffff“ Sekunde und dezimale Bruchteile einer Sekunde — Z: Zeitzone UTC (koordinierte Weltzeit) Datum und Uhrzeit sind in UTC anzugeben.
{DATEFORMAT}	Datumsformat gemäß ISO 8601	Formatierung des Datums: JJJJ-MM-TT.
{DECIMAL-n/m}	Dezimalzahl von bis zu n Stellen insgesamt, von denen bis zu m Stellen Bruchziffern sein können	Numerisches Feld für positive und negative Werte. <ul style="list-style-type: none"> — Dezimaltrennzeichen: „.“ (Punkt) — Negativen Zahlen wird „-“ (Minuszeichen) vorangestellt Werte werden gerundet und nicht gekürzt.

SYMBOL	DATENTYP	DEFINITION
{INDEX}	4 Buchstaben	<p>„EONA“ — EONIA</p> <p>„EONS“ — EONIA SWAP</p> <p>„EURI“ — EURIBOR</p> <p>„EUUS“ — EURODOLLAR</p> <p>„EUCH“ — EuroSwiss</p> <p>„GCFR“ — GCF REPO</p> <p>„ISDA“ — ISDAFIX</p> <p>„LIBI“ — LIBID</p> <p>„LIBO“ — LIBOR</p> <p>„MAAA“ — Muni AAA</p> <p>„PFAN“ — Pfandbriefe</p> <p>„TIBO“ — TIBOR</p> <p>„STBO“ — STIBOR</p> <p>„BBSW“ — BBSW</p> <p>„JIBA“ — JIBAR</p> <p>„BUBO“ — BUBOR</p> <p>„CDOR“ — CDOR</p> <p>„CIBO“ — CIBOR</p> <p>„MOSP“ — MOSPRIM</p> <p>„NIBO“ — NIBOR</p> <p>„PRBO“ — PRIBOR</p> <p>„TLBO“ — TELBOR</p> <p>„WIBO“ — WIBOR</p> <p>„TREA“ — Treasury</p> <p>„SWAP“ — SWAP</p> <p>„FUSW“ — Future SWAP</p>
{INTEGER-n}	Ganze Zahl von bis zu n Stellen insgesamt	Numerisches Feld für sowohl positive als auch negative ganze Zahlenwerte
{ISIN}	12 alphanumerische Zeichen	ISIN-Code gemäß ISO 6166
{LEI}	20 alphanumerische Zeichen	LEI-Code gemäß ISO 17442
{MIC}	4 alphanumerische Zeichen	MIC-Code gemäß ISO 10383
{FISN}	35 alphanumerische Zeichen	FISN-Code gemäß ISO 18774.

Tabelle 2

Klassifizierung von Warenderivaten und Derivaten von Emissionszertifikaten für Tabelle 3 (Felder 35-37)

Basisprodukt	Unterprodukt	Weiteres Unterprodukt
„AGRI“ — Agrarprodukt	„GROS“ — Getreide und Ölsaaten	„FWHT“ — Futterweizen „SOYB“ — Sojabohnen „CORN“ — Mais „RPSD“ — Raps „RICE“ — Reis „OTHR“ — Sonstiges
	„SOFT“ — Weichwaren	„CCOA“ — Kakao „ROBU“ — Robusta-Kaffee „WHSZ“ — Weißzucker „BRWN“ — Rohzucker „OTHR“ — Sonstiges
	„POTA“ — Kartoffeln	
	„OOLI“ — Olivenöl	„LAMP“ — Lampantöl
	„DIRY“ — Molkereiprodukte	
	„FRST“ — forstwirtschaftliche Produkte	
	„SEAF“ — Fisch und Meeresfrüchte	
	„LSTK“ — Vieh	
	„GRIN“ — Getreide	„MWHT“ — Mahlweizen
„NRGY“ — Energie	„ELEC“ — Strom	„BSLD“ — Grundlast „FITR“ — finanzielle Übertragungsrechte „PKLD“ — Spitzenlast „OFFP“ — Schwachlast „OTHR“ — Sonstiges
	„NGAS“ — Erdgas	„GASP“ — GASPOOL „LNGG“ — LNG „NBPG“ — NBP „NCGG“ — NCG „TTFG“ — TTF

Basisprodukt	Unterprodukt	Weiteres Unterprodukt
	„OILP“ — Öl	„BAKK“ — Bakken „BDSL“ — Biodiesel „BRNT“ — Brent „BRNX“ — Brent NX „CNDA“ — Kanadisch „COND“ — Kondensat „DSEL“ — Diesel „DUBA“ — Dubai „ESPO“ — ESPO „ETHA“ — Ethanol „FUEL“ — Brennstoff „FOIL“ — Motorentreibstoffe „GOIL“ — Gasöl „GSLN“ — Ottokraftstoff „HEAT“ — Heizöl „JTFL“ — Flugturbinenkraftstoff „KERO“ — Kerosin „LLSO“ — Light Louisiana Sweet (LLS) „MARS“ — MARS „NAPH“ — Naphtha „NGLO“ — NGL „TAPI“ — Tapis „URAL“ — Ural „WTIO“ — WTI
	„COAL“ — Kohle „INRG“ — Arbitragegeschäft „RNNG“ — erneuerbare Energie „LGHT“ — leichte Bestandteile „DIST“ — Destillate	
„ENVR“ — Umwelt	„EMIS“ — Emissionen	„CERE“ — CER „ERUE“ — ERU „EUAE“ — EUA „EUAA“ — EUAA „OTHR“ — Sonstige
	„WTHR“ — Wetter „CRBR“ — Kohlenstoff	

Basisprodukt	Unterprodukt	Weiteres Unterprodukt
„FRGT“ — Fracht	„WETF“ — Nass	„TNKR“ — Tanker
	„DRYF“ — Trocken	„DBCR“ — Massengutschiff
	„CSHP“ — Containerschiffe	
„FRTL“ — Dünger	„AMMO“ — Ammoniak „DAPH“ — DAP (Diammoniumphosphat) „PTSH“ — Kali „SLPH“ — Schwefel „UREA“ — Harnstoff „UAAN“ — UAN (Harnstoff und Ammoniumnitrat)	
„INDP“ — Industrieerzeugnisse	„CSTR“ — Baugewerbe „MFTG“ — Verarbeitendes Gewerbe	
„METL“ — Metalle	„NPRM“ — Nichtelegmetalle	„ALUM“ — Aluminium „ALUA“ — Aluminiumlegierung „CBLT“ — Kobalt „COPR“ — Kupfer „IRON“ — Eisenerz „LEAD“ — Blei „MOLY“ — Molybdän „NASC“ — NASAAC „NICK“ — Nickel „STEL“ — Stahl „TINN“ — Zinn „ZINC“ — Zink „OTHR“ — Sonstiges
	„PRME“ — Edelmetalle	„GOLD“ — Gold „SLVR“ — Silber „PTNM“ — Platin „PLDM“ — Palladium „OTHR“ — Sonstiges
„MCEX“ — Multi Commodity exotisch		
„PAPR“ — Papier	„CBRD“ — Wellpappenroh papier „NSPT“ — Zeitungsdruckpapier „PULP“ — Holz- und Zellstoff „RCVP“ — Recyclingpapier	

Basisprodukt	Unterprodukt	Weiteres Unterprodukt
„POLY“ — Polypropylen	„PLST“ — Kunststoff	
„INFL“ — Inflation		
„OEST“ — Offizielle Wirtschaftsstatistik		
„OTHC“ — Sonstige C10 entsprechend der Definition in Anhang III Abschnitt „Sonstige C10-Derivate“, Tabelle 10.1, der Delegierten Verordnung der Kommission zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf technische Regulierungsstandards für Transparenzanforderungen für Handelsplätze und Wertpapierfirmen in Bezug auf Schuldverschreibungen, strukturierte Finanzprodukte, Emissionszertifikate und Derivate.	„DLVR“ — Lieferbar „NDLV“ — Nicht lieferbar	
„OTHR“ — Sonstige		

Tabelle 3

Normen und Format für die Meldungen nach Artikel 4 Absatz 1 und 2 der Verordnung (EU) Nr. 596/2014

Nr.	FELD	FÜR DIE MELDUNGEN ZU VERWENDENDEN STANDARDS UND FORMATE
Allgemeine Felder		
1	Kennung des Instruments	{ISIN}
2	Vollständige Bezeichnung des Instruments	{ALPHANUM-350}
3	Klassifizierung des Instruments	{CFI_CODE}
4	Indikator für Warenderivate	„richtig“ — Ja „falsch“ — Nein
Felder mit Bezug auf den Emittenten		
5	Kennung des Emittenten oder Handelsplatzbetreibers	{LEI}
Felder mit Bezug auf den Handelsplatz		
6	Handelsplatz	{MIC}
7	Kurzbezeichnung des Finanzinstruments	{FISN}
8	Antrag auf Zulassung zum Handel durch den Emittenten	„richtig“ — Ja „falsch“ — Nein

Nr.	FELD	FÜR DIE MELDUNGEN ZU VERWEN- DENDE STANDARDS UND FORMATE
9	Datum der Zulassung zum Handel	{DATE_TIME_FORMAT}
10	Datum der Beantragung der Zulassung zum Handel	{DATE_TIME_FORMAT}
11	Datum der Zulassung zum Handel oder Datum des ersten Handelsabschlusses	{DATE_TIME_FORMAT}
12	Kontraktende	{DATE_TIME_FORMAT}

Felder mit Bezug auf den Nennwert

13	Nennwährung 1	{CURRENCYCODE_3}
----	---------------	------------------

Felder mit Bezug auf Schuldverschreibungen und sonstige verbriefte Schuldtitel

14	Ausgebener Gesamtnennbetrag	{DECIMAL-18/5}
15	Fälligkeitstermin	{DATEFORMAT}
16	Währung des Nennbetrags	{CURRENCYCODE_3}
17	Nennwert je Stück/gehandelter Mindestwert	{DECIMAL-18/5}
18	Festsatz	{DECIMAL-11/10} Ausgedrückt als Prozentanteil (z. B. 7.0 bedeutet 7 % und 0.3 bedeutet 0,3 %)
19	Kennung des Indexes/Benchmark einer variabel verzinslichen Schuldverschreibung	{ISIN}
20	Bezeichnung des Indexes/Benchmarks einer variabel verzinslichen Schuldverschreibung	{INDEX} oder {ALPHANUM-25} — wenn die Bezeichnung des Index nicht in der {INDEX}-Liste enthalten ist
21	Laufzeit des Indexes/Benchmark einer variabel verzinslichen Schuldverschreibung	{INTEGER-3}+„TAGE“ — Tage {INTEGER-3}+„WOCHE“ — Wochen {INTEGER-3}+„MONATE“ — Monate {INTEGER-3}+„JAHR“ — Jahre
22	Basispunkt-Spread des Indexes/Benchmark einer variabel verzinslichen Schuldverschreibung	{INTEGER-5}
23	Vorrangigkeit der Schuldverschreibung	„SNDB“ — vorrangige Schuld „MZZD“ — Mezzanin „SBOD“ — nachrangig „JUND“ — Junior

Nr.	FELD	FÜR DIE MELDUNGEN ZU VERWEN- DENDE STANDARDS UND FORMATE
Felder mit Bezug auf Derivate und verbriefte Derivate		
24	Ablaufdatum:	{DATEFORMAT}
25	Preismultiplikator	{DECIMAL-18/17}
26	Code des Basisinstruments	{ISIN}
27	Basisemittent	{LEI}
28	Bezeichnung des Basisindex	{INDEX} oder {ALPHANUM-25} — wenn die Bezeichnung des Index nicht in der {INDEX}-Liste enthalten ist
29	Laufzeit des Basisindex	{INTEGER-3}+„TAGE“ — Tage {INTEGER-3}+„WOCHE“ — Wochen {INTEGER-3}+„MONATE“ — Monate {INTEGER-3}+„JAHR“ — Jahre
30	Art der Option	„PUTO“ — Put-Option „CALL“ — Call-Option „OTHR“ — wenn nicht bestimmt werden kann, ob es sich um eine Call- oder Put-Option handelt
31	Ausübungspreis	{DECIMAL-18/13} wenn der Preis als Geldwert angegeben wird {DECIMAL-11/10} wenn der Preis als Prozentsatz oder Rendite angegeben wird {DECIMAL-18/17} wenn der Preis als Basispunkte angegeben wird „PNDG“ wenn der Preis nicht verfügbar ist
32	Währung des Ausübungspreises	{CURRENCYCODE_3}
33	Art der Option (mögliche Ausübung)	„EURO“ — Europäische Option „AMER“ — Amerikanische Option „ASIA“ — Asiatische Option „BERM“ — Bermuda-Option „OTHR“ — Sonstige
34	Art der Lieferung	„PHYS“ — physisch „CASH“ — bar „OPTN“ — Optional für die Gegenpartei oder bei Festlegung durch einen Dritten

Nr.	FELD	FÜR DIE MELDUNGEN ZU VERWEN- DENDE STANDARDS UND FORMATE
Warenderivate und Derivate von Emissionszertifikaten		
35	Basisprodukt	Es sind nur Eintragungen aus der Spalte „Basisprodukt“ der Tabelle zur Klassifizierung von Warenderivaten und Derivaten von Emissionszertifikaten zulässig.
36	Unterprodukt	Es sind nur Eintragungen aus der Spalte „Unterprodukt“ der Tabelle zur Klassifizierung von Warenderivaten und Derivaten von Emissionszertifikaten zulässig.
37	Weiteres Unterprodukt	Es sind nur Eintragungen aus der Spalte „Weiteres Unterprodukt“ der Tabelle zur Klassifikation von Warenderivaten und Derivaten von Emissionszertifikaten zulässig.
38	Art der Transaktion	„FUTR“ — Terminkontrakt „OPTN“ — Option „TAPO“ — TAPO „SWAP“ — Swap „MINI“ — Mini-Future „OTCT“ — OTC-Derivate „ORIT“ — Direktverkauf „CRCK“ — Crack-Option „DIFF“ — Differenzgeschäft „OTHR“ — Sonstiges
39	Art des Schlusskurses	„ARGM“ — Argus/McCloskey „BLTC“ — Baltic „EXOF“ — Exchange „GBCL“ — GlobalCOAL „IHSM“ — IHS McCloskey „PLAT“ — Platts „OTHR“ — Sonstige

Zinsderivate

— Die Felder in diesem Abschnitt sollten nur für Instrumente ausgefüllt werden, deren Basiswert ein Nicht-Finanzinstrument vom Typ Zinssatz ist.

40	Referenzzinssatz	{INDEX} oder {ALPHANUM-25} — wenn der Referenzzinssatz nicht in der {INDEX}-Liste enthalten ist
----	------------------	-------------------------------------------------------------------------------------------------------

Nr.	FELD	FÜR DIE MELDUNGEN ZU VERWEN- DENDE STANDARDS UND FORMATE
41	IR-Kontraktlaufzeit	{INTEGER-3}+„TAGE“ — Tage {INTEGER-3}+„WOCHE“ — Wochen {INTEGER-3}+„MONATE“ — Monate {INTEGER-3}+„JAHR“ — Jahre
42	Nennwährung 2	{CURRENCYCODE_3}
43	Festsatz, Leg 1	{DECIMAL-11/10} Ausgedrückt als Prozentanteil (z. B. 7.0 bedeutet 7 % und 0.3 bedeutet 0,3 %)
44	Festsatz, Leg 2	{DECIMAL-11/10} Ausgedrückt als Prozentanteil (z. B. 7.0 bedeutet 7 % und 0.3 bedeutet 0,3 %)
45	Variabler Satz, Leg 2	{INDEX} oder {ALPHANUM-25} — wenn der Referenzsatz nicht in der {INDEX}-Liste enthalten ist
46	IR-Kontraktlaufzeit von Leg 2	{INTEGER-3}+„TAGE“ — Tage {INTEGER-3}+„WOCHE“ — Wochen {INTEGER-3}+„MONATE“ — Monate {INTEGER-3}+„JAHR“ — Jahre

Fremdwährungsderivate

— Die Felder in diesem Abschnitt sollten nur für Instrumente ausgefüllt werden, deren Basiswert ein Nicht-Finanzinstrument vom Typ Fremdwährung ist.

47	Nennwährung 2	{CURRENCYCODE_3}
48	FX-Art	„FXCR“ — FX Cross Rates „FXEM“ — FX Emerging Markets „FXMJ“ — FX Majors