

Brüssel, den 14. Juli 2026
(OR. en)

11909/26
ADD 1

EF 209
ECOFIN 1019
DELECT 115

ÜBERMITTLUNGSVERMERK

Absender:	Frau Martine DEPREZ, Direktorin, im Auftrag der Generalsekretärin der Europäischen Kommission
Eingangsdatum:	13. Juli 2026
Empfänger:	Frau Thérèse BLANCHET, Generalsekretärin des Rates der Europäischen Union
Nr. Komm.dok.:	C(2026) 4777 annex
Betr.:	ANHÄNGE der DELEGIERTEN VERORDNUNG (EU) .../... DER KOMMISSION zur Änderung der in den Delegierten Verordnungen (EU) 2017/583 zu Transparenzanforderungen für Handelsplätze und Wertpapierfirmen in Bezug auf Derivate, (EU) 2017/2194 im Hinblick auf Auftragspakete und (EU) 2025/1155 hinsichtlich der Input- und Outputdaten des konsolidierten Datentickers für OTC-Derivate festgelegten technischen Regulierungsstandards sowie zur Berichtigung der Delegierten Verordnung (EU) 2017/587 der Kommission

Die Delegationen erhalten als Anlage das Dokument C(2026) 4777 annex.

Anl.: C(2026) 4777 annex



EUROPÄISCHE
KOMMISSION

Brüssel, den 13.7.2026
C(2026) 4777 final

ANNEXES 1 to 3

ANHÄNGE

der

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

**zur Änderung der in den Delegierten Verordnungen (EU) 2017/583 zu
Transparenzanforderungen für Handelsplätze und Wertpapierfirmen in Bezug auf
Derivate, (EU) 2017/2194 im Hinblick auf Auftragspakete und (EU) 2025/1155
hinsichtlich der Input- und Outputdaten des konsolidierten Datentickers für OTC-
Derivate festgelegten technischen Regulierungsstandards sowie zur Berichtigung der
Delegierten Verordnung (EU) 2017/587 der Kommission**

ANHANG I

Die Delegierte Verordnung (EU) 2017/583 wird wie folgt geändert:

1. In Anhang II erhalten die Tabellen 2 und 3 die folgende Fassung:

„Tabelle 2
Liste der Einzelheiten für die Zwecke der Nachhandelstransparenz

Die veröffentlichten Feldbezeichnungen (Spaltenüberschriften) müssen mit dem Feldnamen in Tabelle 2 identisch sein.

#	Feldname	Finanzinstrumente	Beschreibung und zu veröffentlichende Einzelheiten	Art des Ausführungs- oder Veröffentlichungsplatzes	Nach den Vorgaben in Tabelle 1 einzuhaltendes Format
1	Handelsdatum und -zeit	Für alle Finanzinstrumente	Datum und Uhrzeit der Geschäftsausführung. Bei Geschäften, die an einem Handelsplatz ausgeführt werden, muss die Granularität den Anforderungen des Artikels 12 der Delegierten Verordnung (EU) 2025/1155 der Kommission ¹ entsprechen. Bei nicht an einem Handelsplatz ausgeführten Geschäften sind Datum und	Geregelter Markt (RM) Multilaterale Handelssysteme (MTF) Organisiertes Handelssystem (OTF) Genehmigtes Veröffentlichungssystem	{DATE_TIME_FORMAT}

¹ Delegierte Verordnung (EU) 2025/1155 der Kommission vom 12. Juni 2025 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Festlegung der Input- und Outputdaten konsolidierter Datenticker, der Synchronisierung von im Geschäftsverkehr verwendeten Uhren und der Umverteilung der Einnahmen durch den Bereitsteller konsolidierter Datenticker für Aktien und börsengehandelte Fonds und zur Aufhebung der Delegierten Verordnung (EU) 2017/574 der Kommission (ABl. L, 2025/1155, 3.11.2025, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2025/1155/oj).

			Uhrzeit anzugeben, zu dem/der (APA) sich die Parteien auf den Inhalt folgender Felder geeinigt haben: Menge, Preis, Währungen nach Maßgabe der Felder 31, 34 und 44 in Anhang I Tabelle 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/590 der Kommission², Kennung des Instruments, Klassifizierung des Instruments und Code des zugrunde liegenden Instruments, sofern anwendbar. Für Geschäfte, die nicht auf einem Handelsplatz ausgeführt werden, ist in Bezug auf die Uhrzeit die nächste Sekunde anzugeben. Resultiert das Geschäft aus einem Auftrag, der von der ausführenden Firma im Auftrag eines Kunden an einen Dritten übermittelt wurde, ohne dass die in Artikel 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/590 aufgeführten Voraussetzungen	
--	--	--	---	--

² Delegierte Verordnung (EU) 2017/590 der Kommission vom 28. Juli 2016 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für die Meldung von Geschäften an die zuständigen Behörden (ABl. L 87 vom 31.3.2017, S. 449, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2017/590/oj).

			erfüllt waren, so ist nicht der Zeitpunkt der Auftragsübermittlung, sondern sind Datum und Uhrzeit des Geschäfts anzugeben.		
2	Kennung des Instruments	Für alle Finanzinstrumente	Code zur Identifizierung des Finanzinstruments. Bei OTC-Derivaten im Sinne von Artikel 8a Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 erfolgt die Identifizierung des Instruments gemäß der Delegierten Verordnung (EU) 2025/1003 der Kommission ³ .	RM, MTF, OTF, APA	{ISIN} außer bei OTC-Derivaten im Sinne von Artikel 8a Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014
2a	Geltungsbeginn	Bei OTC-Zinsderivaten	Datum, an dem die Verpflichtungen aus dem Zinsderivatkontrakt wirksam werden.	MTF, OTF, APA	{DATEFORMAT}
2b	Fälligkeit	Bei OTC-Zinsderivaten	Fälligkeit des Zinsderivatkontrakts.	MTF, OTF, APA	{DATEFORMAT}
3	Preis	Für alle Finanzinstrumente	Handelspreis des Geschäfts, ggf. ohne Provision und	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/13}, wenn der Preis als Geldwert

³ Delegierte Verordnung (EU) 2025/1003 der Kommission vom 24. Januar 2025 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates in Bezug auf die identifizierenden Referenzdaten für OTC-Derivate, die für die Zwecke der in Artikel 8a Absatz 2 und den Artikeln 10 und 21 festgelegten Transparenzanforderungen zu verwenden sind (ABl. L, 2025/1003, 22.5.2025, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2025/1003/oj).

			aufgelaufene Zinsen. Der gehandelte Preis ist gemäß der Standardmarktkonvention zu melden. Der in diesem Feld ausgewiesene Wert muss mit dem im Feld ‚Preisangabe‘ genannten Wert übereinstimmen. Ist der Preis momentan nicht verfügbar, sondern noch ‚in der Schwebe‘ (‚PNDG‘) oder nicht anwendbar (‚NOAP‘), ist dieses Feld nicht auszufüllen.		angegeben wird {DECIMAL-11/10}, wenn der Preis als Prozentsatz oder Rendite angegeben wird {DECIMAL-18/17}, wenn der Preis als Basispunkte angegeben wird
4	Fehlender Preis	Für alle Finanzinstrumente	Wenn der Preis momentan nicht verfügbar, sondern ‚in der Schwebe‘ ist, wird der Wert ‚PNDG‘ angegeben. Wenn kein Preis anwendbar ist, lautet der Wert ‚NOAP‘.	RM, MTF, OTF, APA	‚PNDG‘, wenn der Preis nicht verfügbar ist ‚NOAP‘, wenn der Preis nicht anwendbar ist
5	Preiswährung	Für alle Finanzinstrumente	Hauptwährung, in der der Preis angegeben ist (sofern der Preis als Geldwert angegeben ist).	RM, MTF, OTF, APA	{CURRENCY CODE_3}
6	Preisangabe	Für alle Finanzinstrumente	Angabe, ob der Preis als Geldwert, als Prozentsatz, als Basispunkte oder als Rendite angegeben wird. Die Preisangabe ist gemäß der	RM, MTF, OTF, APA	‚MONE‘ – Geldwert ‚PERC‘ – Prozentsatz ‚YIEL‘ – Rendite ‚BAPO‘ – Basispunkte

			Standardmarktkonvention zu melden. Bei Credit Default Swaps ist in diesem Feld ‚BAPO‘ einzutragen. Bei Anleihen (außer ETN und ETC) ist in diesem Feld der Prozentsatz (PERC) des Nennbetrags anzugeben. Entspricht ein Preis als Prozentsatz nicht der Standardmarktkonvention, so ist er gemäß der Standardmarktkonvention mit YIEL, BAPO oder MONE anzugeben. Der in diesem Feld zu nennende Wert muss mit dem im Feld ‚Preis‘ genannten Wert übereinstimmen. Wenn der Preis als monetärer Wert ausgedrückt wird, ist er in der Hauptwährungseinheit anzugeben. Ist der Preis derzeit nicht verfügbar, sondern noch ‚in der Schwebe‘ (‚PNDG‘) oder nicht anwendbar (‚NOAP‘), ist dieses Feld nicht auszufüllen.		
--	--	--	--	--	--

7	Menge	Für alle Finanzinstrumente	Bei Finanzinstrumenten, die in Einheiten gehandelt werden, die Anzahl der Einheiten des Finanzinstruments. Ansonsten unausgefüllt.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/17}
8	Menge in Maßeinheit	Bei Verträgen in Einheiten für Warenderivate, C10-Derivate, Emissionszertifikatderivate und Emissionszertifikate.	Der Gegenwert der gehandelten Ware oder des Emissionszertifikats wird in der Maßeinheit ausgedrückt.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/17}
9	Angabe der Menge in der Maßeinheit	Bei Verträgen in Einheiten für Warenderivate, C10-Derivate, Emissionszertifikatderivate und Emissionszertifikate.	Angabe der Maßeinheit, in der die Menge in der Maßeinheit angegeben ist.	RM, MTF, OTF, APA	‚TOCD‘ – Tonnen Kohlendioxid-Äquivalente für Verträge im Zusammenhang mit Emissionszertifikaten ‚TONE‘ – metrische Tonnen ‚MWHO‘ – Megawattstunden ‚MBTU‘ – eine Million BTU (British thermal units) ‚THMS‘ – Therm ‚DAYS‘ – Tage {ALPHANUM-4} auf andere Weise

10	Nennbetrag	Für alle Finanzinstrumente	Dieses Feld ist auszufüllen: i) für Anleihen (ausgenommen ETC und ETN) mit dem Nennwert, d. h. dem Betrag, der bei Rückzahlung an den Anleger zurückgezahlt wird; ii) für ETC, ETN und verbriefte Derivate mit der Anzahl der zwischen Käufern und Verkäufern gehandelten Instrumente multipliziert mit dem Preis des für das betreffende Geschäft gehandelten Instruments. Entsprechend mit dem Feld ‚Preis‘ multipliziert mit dem Feld ‚Menge‘; iii) für strukturierte Finanzprodukte (SFP) mit dem Nennwert je Einheit	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/5}
----	------------	----------------------------	---	-------------------	----------------

			multipliziert mit der Anzahl der Instrumente zum Zeitpunkt des Geschäfts; iv) für Credit Default Swaps mit dem Nennbetrag, für den der Schutz erworben oder veräußert wird; v) für Optionen, Swaptions, Swaps, die nicht unter Ziffer iv genannt werden, Futures und Forwards, mit dem Nennbetrag des Vertrags; vi) für Emissionszertifikate mit dem Betrag, der sich aus der Menge zum vertraglich festgelegten Preis zum Zeitpunkt des Geschäfts ergibt. Entsprechend mit dem Feld „Preis“ multipliziert		
--	--	--	--	--	--

			mit dem Feld „Menge“; vii) für Spread Bets mit dem Geldwert nach Punktbewegung des zugrunde liegenden Finanzinstruments zum Zeitpunkt des Geschäfts; viii) für Differenzgeschäfte mit der Anzahl der zwischen Käufern und Verkäufern gehandelten Instrumente multipliziert mit dem Preis des für das betreffende Geschäft gehandelten Instruments. Entsprechend mit dem Feld „Preis“ multipliziert mit dem Feld „Menge“;		
11	Nennwährung	Für alle Finanzinstrumente	Die Hauptwährung, in der der Nennbetrag angegeben ist. Im Falle eines	RM, MTF, OTF, APA	{CURRENCY CODE_3}

			Devisenderivatvertrags oder eines Multi-Currency Swaps oder einer Swaption, bei denen es sich bei dem zugrunde liegenden Swap um einen Multi-Currency- oder einen Währungs-CFD- oder Spread Betting-Vertrag handelt, ist dies die Nennwährung von Leg 1.		
12	[gestrichen]				
13	Ausführungsplatz	Für alle Finanzinstrumente	Angabe des Platzes, an dem das Geschäft ausgeführt wurde. Das Segment MIC ist für Geschäfte zu verwenden, die an einem Handelsplatz in der EU ausgeführt werden. Falls es kein Segment MIC gibt, Operating MIC. Für ein zum Handel zugelassenes oder auf einem Handelsplatz gehandeltes Finanzinstrument ,SINT‘ verwenden, sofern das Geschäft in Bezug auf das Finanzinstrument durch einen systematischen Internalisierer ausgeführt wird.	RM, MTF, OTF, APA	{MIC} – Handelsplätze in der EU oder ,SINT‘ – systematische Internalisierer ,XOFF‘ – Sonstiges

			Für ein zum Handel zugelassenes oder auf einem Handelsplatz gehandeltes Finanzinstrument ‚MIC‘ oder ‚XOFF‘ verwenden, sofern das Geschäft in Bezug auf das Finanzinstrument weder auf einem EU-Handelsplatz noch durch einen systematischen Internalisierer ausgeführt wird. Wird das Geschäft auf einer organisierten Handelsplattform außerhalb der EU ausgeführt, muss neben ‚XOFF‘ auch das Feld ‚Handelsplatz der Ausführung im Drittland‘ ausgefüllt werden.		
14	Handelsplatz der Ausführung im Drittland	Für alle Finanzinstrumente	Angabe des Handelsplatzes im Drittland, an dem das Geschäft getätigt wurde. Segment MIC ist zu verwenden. Falls es kein Segment MIC gibt, Operating MIC. Wird das Geschäft nicht an einem Handelsplatz im Drittland ausgeführt, muss das Feld nicht ausgefüllt werden.	APA	{MIC}
15	Datum und Uhrzeit der Veröffentlichung	Für alle Finanzinstrumente	Datum und Uhrzeit, zu dem bzw. der das Geschäft von	RM, MTF, OTF, APA	{DATE_TIME_FORMAT}

			einem Handelsplatz oder APA veröffentlicht wurde. Bei Geschäften, die an einem Handelsplatz ausgeführt werden, muss die Granularität den Anforderungen des Artikels 12 der Delegierten Verordnung (EU) 2025/1155 entsprechen. Für Geschäfte, die nicht auf einem Handelsplatz ausgeführt werden, ist in Bezug auf die Uhrzeit die nächste Sekunde anzugeben.		
16	Veröffentlichungsplatz	Für alle Finanzinstrumente	Code zur Identifizierung des Handelsplatzes und APA, welche das Geschäft veröffentlichen.	RM, MTF, OTF, APA	{MIC}
17	Transaktionsidentifikationscode	Für alle Finanzinstrumente	Alphanumerischer Code, der von Handelsplätzen (gemäß Artikel 12 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/580 der Kommission ⁴) und APA vergeben wird und in allen	RM, MTF, OTF, APA	{ALPHA NUMERICAL-52}

⁴ Delegierte Verordnung (EU) 2017/580 der Kommission vom 24. Juni 2016 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für die Aufzeichnung einschlägiger Daten über Aufträge für Finanzinstrumente (ABl. L 87 vom 31.3.2017, S. 193, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2017/580/oj).

			nachfolgenden Bezugnahmen auf den spezifischen Handel verwendet wird.		
18	[gestrichen]				
19	Kennzeichen	Für alle Finanzinstrumente	Ein oder mehrere Felder sollten mit den entsprechenden Kennzeichen gemäß Anhang II Tabelle 3 ausgefüllt werden. Trifft keiner der genannten Umstände zu, ist das Geschäft ohne Kennzeichen zu veröffentlichen. Wenn eine Kombination von Kennzeichen möglich ist und in einem Feld angegeben wird, sind die Kennzeichen durch Kommata zu trennen.	RM, MTF, OTF, APA	Gemäß Anhang II Tabelle 3
20	Handelssystem	Für alle Finanzinstrumente	Art des Handelssystems, in dem das Geschäft ausgeführt wurde. Wird Feld ‚Ausführungsplatz‘ mit ‚SINT‘ oder ‚XOFF‘ ausgefüllt, ist dieses Feld nicht auszufüllen.	RM, MTF, OTF	‚CLOB‘ – auf einem zentralen Limit-Orderbuch basierendes Handelssystem. ‚QDTS‘ – quotierungsgetriebenes Handelssystem, d. h. ein System, bei dem die Geschäfte auf der Grundlage verbindlicher Kursofferten abgeschlossen werden, die

					den Teilnehmern kontinuierlich zur Verfügung gestellt werden, was die Market-Maker dazu anhält, ständig Kursofferten in einer Größenordnung zu halten, die das Erfordernis für Mitglieder und Teilnehmer, in einer kommerziellen Größenordnung zu handeln, mit den Risiken für die Market-Maker selbst in Einklang bringt. „PATs“ – auf periodischen Auktionen basierendes Handelssystem. „RFQT“ – Preisanfrage-Handelssystem, d. h. ein Handelssystem, bei dem eine Kursofferte oder Kursofferten als Antwort auf eine diesbezügliche Anfrage eines oder mehrerer Mitglieder oder Teilnehmer abgegeben werden. Die Kursofferte ist ausschließlich von dem anfragenden Mitglied oder Teilnehmer ausführbar. Das
--	--	--	--	--	--

					anfragende Mitglied bzw. der anfragende Teilnehmer kann ein Geschäft abschließen, indem er die auf Anfrage gestellte(n) Kursofferte(n) annimmt. ‚VOIC‘ – sprachbasiertes Handelssystem, d. h. ein Handelssystem, bei dem Geschäfte zwischen Mitgliedern durch eine sprachbasierte Verhandlung vereinbart werden. ‚HYBR‘ – hybrides Handelssystem, d. h. ein System, das unter zwei oder mehr der vorstehend genannten Arten von Handelssystemen fällt. ‚OTHR‘ – sonstiges Handelssystem, d. h. jede andere Art von Handelssystem, die vorstehend nicht genannt wurde.
21	Anzahl der Geschäfte	Für öffentliche Schuldtitel	In diesem Feld ist die Anzahl	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/17}

			der ausgeführten Geschäfte anzugeben, wenn die spätere Veröffentlichung der Einzelheiten zu mehreren Geschäften in aggregierter Form gemäß Artikel 11 Absatz 3 Buchstabe b der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 erforderlich ist.		
--	--	--	---	--	--

Tabelle 3
Liste der Kennzeichen zu Zwecken der Nachhandelstransparenz

KENNZEICHEN FÜR NACHHANDELSAUFSCHÜBE BEI ANLEIHEN (AUßER ETC UND ETN) UND BESTIMMTEN DERIVATEN			
Kennzeichen	Bezeichnung	Art des Ausführungs- oder Veröffentlichungsplatzes	Beschreibung
MLF1	Kennzeichen für mittleres Volumen, liquider Markt	RM, MTF, OTF, APA	Geschäfte mit Anleihen, für die gemäß Artikel 8a Absatz 1 Buchstabe a dieser Verordnung ein Aufschub für Geschäfte mittleren Volumens mit einem Finanzinstrument, für das ein liquider Markt besteht, gilt. Geschäfte mit Derivaten, für die gemäß Artikel 8 dieser Verordnung ein Aufschub für Geschäfte mittleren Volumens mit einem Finanzinstrument, für das ein liquider Markt besteht, gilt.

MIF2	Kennzeichen für mittleres Volumen, illiquider Markt	RM, MTF, OTF, APA	Geschäfte mit Anleihen, für die gemäß Artikel 8a Absatz 1 Buchstabe b dieser Verordnung ein Aufschub für Geschäfte mittleren Volumens mit einem Finanzinstrument, für das kein liquider Markt besteht, gilt. Geschäfte mit Derivaten, für die gemäß Artikel 8 dieser Verordnung ein Aufschub für Geschäfte mittleren Volumens mit einem Finanzinstrument, für das kein liquider Markt besteht, gilt.
LLF3	Kennzeichen für großes Volumen, liquider Markt	RM, MTF, OTF, APA	Geschäfte mit Anleihen, für die gemäß Artikel 8a Absatz 1 Buchstabe c dieser Verordnung ein Aufschub für Geschäfte großen Volumens mit einem Finanzinstrument, für das ein liquider Markt besteht, gilt. Geschäfte mit Kreditderivaten, für die gemäß Artikel 8 dieser Verordnung ein Aufschub für Geschäfte großen Volumens mit einem Finanzinstrument, für das ein liquider Markt besteht, gilt. Geschäfte mit Zinsderivaten, für die gemäß Artikel 8 dieser Verordnung ein Aufschub für Geschäfte großen/sehr großen Volumens mit einem Finanzinstrument, für das ein liquider Markt besteht, gilt.
LIF4	Kennzeichen für großes Volumen, illiquider Markt	RM, MTF, OTF, APA	Geschäfte mit Anleihen, für die gemäß Artikel 8a Absatz 1 Buchstabe d dieser Verordnung ein Aufschub für Geschäfte großen Volumens mit einem Finanzinstrument, für das kein liquider Markt besteht, gilt. Geschäfte mit Kreditderivaten, für die gemäß Artikel 8 dieser Verordnung ein Aufschub für Geschäfte großen Volumens mit einem Finanzinstrument, für das kein liquider Markt besteht, gilt. Geschäfte mit Zinsderivaten, für die gemäß Artikel 8 dieser Verordnung ein Aufschub für Geschäfte großen/sehr großen Volumens mit einem Finanzinstrument, für das kein liquider Markt besteht, gilt.

VLF5	Kennzeichen für sehr großes Volumen, liquider Markt	RM, MTF, OTF, APA	Geschäfte mit Anleihen, für die gemäß Artikel 8a Absatz 1 Buchstabe e dieser Verordnung ein Aufschub für Geschäfte sehr großen Volumens mit einem Finanzinstrument, für das ein liquider Markt besteht, gilt. Geschäfte mit Kreditderivaten, für die gemäß Artikel 8 dieser Verordnung ein Aufschub für Geschäfte sehr großen Volumens mit einem Finanzinstrument, für das ein liquider Markt besteht, gilt.
VIF5	Kennzeichen für sehr großes Volumen, illiquider Markt	RM, MTF, OTF, APA	Geschäfte mit Anleihen, für die gemäß Artikel 8a Absatz 1 Buchstabe e dieser Verordnung ein Aufschub für Geschäfte sehr großen Volumens mit einem Finanzinstrument, für das kein liquider Markt besteht, gilt. Geschäfte mit Kreditderivaten, für die gemäß Artikel 8 dieser Verordnung ein Aufschub für Geschäfte sehr großen Volumens mit einem Finanzinstrument, für das kein liquider Markt besteht, gilt.

KENNZEICHEN FÜR NACHHANDELSAUFSCHÜBE BEI ETC, ETN, SFP, EMISSIONSZERTIFIKATEN UND BESTIMMTEN DERIVATEN			
Kennzeichen	Bezeichnung	Art des Ausführungs- oder Veröffentlichungsplatzes	Beschreibung
DEFF	Aufschub bei ETC, ETN, SFP, Emissionszertifikaten und bestimmten Derivaten	RM, MTF, OTF, APA	Geschäfte mit ETC, ETN, SFP und Emissionszertifikaten, für die gemäß Artikel 8a Absätze 2 und 3 dieser Verordnung ein Aufschub gilt. Geschäfte mit Derivaten, für die ein Aufschub gilt, der für Geschäfte vorgesehen ist, bei denen nur ein Aufschubvolumen zur Verfügung steht.

ERGÄNZENDE KENNZEICHNUNGEN BEI AUFSCHUB FÜR ÖFFENTLICHE ANLEIHEN
--

Artikel 11 Absatz 3 Buchstabe a	„OMIS“	Kennzeichen „Volumenauslassung“	RM, MTF, OTF, APA	Geschäft, für welches gemäß Artikel 11 Absatz 3 Buchstabe a der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 beschränkte Einzelheiten veröffentlicht werden.
	„FULO“	Kennzeichen „vollständige Einzelheiten“	RM, MTF, OTF, APA	Geschäft, für welches zuvor gemäß Artikel 11 Absatz 3 Buchstabe a der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 beschränkte Einzelheiten veröffentlicht wurden.
Artikel 11 Absatz 3 Buchstabe b	„AGFW“	Kennzeichen „Aggregation vier Wochen“	RM, MTF, OTF, APA	Veröffentlichung aggregierter Geschäfte gemäß Artikel 11 Absatz 3 Buchstabe b der Verordnung (EU) Nr. 600/2014.
	„FULG“	Kennzeichen „vollständige Einzelheiten“	RM, MTF, OTF, APA	Einzelgeschäfte, die zuvor in den Genuss der aggregierten Veröffentlichung gemäß Artikel 11 Absatz 3 Buchstabe b der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 gekommen sind.

SONSTIGE KENNZEICHEN			
Kennzeichen	Bezeichnung	Art des Ausführungs- oder Veröffentlichungsplatzes	Beschreibung
„BENC“	Transaktionskennzeichen „Benchmark-Geschäft“	RM, MTF, OTF, APA	Geschäfte, die unter Bezugnahme auf einen Preis ausgeführt werden, der über mehrere Zeitpunkte gemäß einer vorgegebenen Bezugsgröße berechnet wird, wie einen volumengewichteten Durchschnittspreis oder einen zeitlich gewichteten Durchschnittspreis.

„NPFT“	Transaktionskennzeichen „nichtpreisbildend“	RM, MTF, OTF, APA	Nichtpreisbildende Geschäfte gemäß Artikel 2 Absatz 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/590.
„TPAC“	Transaktionskennzeichen „Paket“	RM, MTF, OTF, APA	Transaktionspakete im Sinne von Artikel 2 Absatz 1 Nummer 50 Buchstabe b der Verordnung (EU) Nr. 600/2014, die keinen „Exchange for Physicals“ darstellen.
„XFPH“	Transaktionskennzeichen „Exchange for Physicals“	RM, MTF, OTF, APA	„Exchange for Physicals“ im Sinne von Artikel 2 Absatz 1 Nummer 48 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014.
„CANC“	Kennzeichen für „Cancellation“	RM, MTF, OTF, APA	Wenn ein zuvor veröffentlichtes Geschäft storniert wird.
„AMND“	Kennzeichen für „Amendment“	RM, MTF, OTF, APA	Wenn ein zuvor veröffentlichtes Geschäft geändert wird.
„PORT“	Kennzeichen „Portfoliogeschäft“	RM, MTF, OTF, APA	Geschäfte mit fünf oder mehr verschiedenen Finanzinstrumenten, die zur gleichen Zeit vom gleichen Kunden und zu einem einzigen Lospreis durchgeführt werden und bei dem es sich nicht um ein „Transaktionspaket“ im Sinne von Artikel 2 Absatz 1 Nummer 50 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 handelt.
„MTCH“	Kennzeichen „Zusammenführung sich deckender Kundenaufträge“ (Matched Principal	RM, MTF, OTF, APA	Zusammenführung sich deckender Kundenaufträge, wie in Artikel 4 Absatz 1 Nummer 38 der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates ⁵ definiert.

⁵ Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 15. Mai 2014 über Märkte für Finanzinstrumente sowie zur Änderung der Richtlinien 2002/92/EG und 2011/61/EU (ABl. L 173 vom 12.6.2014, S. 349, ELI: <http://data.europa.eu/eli/dir/2014/65/oj>).

	Trading)		
„NEGO“	Kennzeichen „Ausgehandelte Geschäfte“	RM, MTF, OTF, APA	Geschäfte, die privat ausgehandelt, aber gemäß den Vorschriften eines Handelsplatzes gemeldet werden.

“

2. Anhang III wird wie folgt geändert:

a) Abschnitt 1 erhält folgende Fassung:

„1. Für die Zwecke dieses Anhangs gelten folgende Begriffsbestimmungen:

1. Der Verweis auf das ausstehende Emissionsvolumen in Tabelle 2.2 bezieht sich auf den Gesamtwert der Anleihen, die begeben wurden und momentan von Anlegern gehalten werden.
2. Ein Verweis auf eine ‚Anlageklasse‘ bedeutet einen Verweis auf die folgenden Klassen von Finanzinstrumenten: Anleihen, strukturierte Finanzprodukte, verbrieftete Derivate, Zinsderivate, Eigenkapitalderivate, Warenderivate, Fremdwährungsderivate, Kreditderivate, C10-Derivate, CFD, Emissionszertifikate und Emissionszertifikatderivate.
3. ‚Durchschnittlicher täglicher Nennbetrag (ADNA)‘ bezeichnet den Gesamtumsatz eines bestimmten Finanzinstruments, der bestimmt wird ausgehend von dem Volumenmaß gemäß Anhang II Tabelle 4 und der im Zeitraum gemäß Artikel 13 Absatz 2 anfällt, geteilt durch die Anzahl der Handelstage in diesem Zeitraum bzw. gegebenenfalls den Teil des Jahres, in dem das Finanzinstrument an einem Handelsplatz zum Handel zugelassen war oder gehandelt wurde und sein Handel nicht ausgesetzt war.
4. ‚Durchschnittliche tägliche Anzahl der Geschäfte‘ bezeichnet die Gesamtzahl der Geschäfte, die für ein bestimmtes Finanzinstrument in dem Zeitraum gemäß Artikel 13 ausgeführt werden, geteilt durch die Anzahl der Handelstage in diesem Zeitraum bzw. gegebenenfalls den Teil des Jahres, in dem das Finanzinstrument an einem Handelsplatz zum Handel zugelassen war oder gehandelt wurde und sein Handel nicht ausgesetzt war.
5. ‚Future‘ bezeichnet einen Vertrag zum Kauf oder Verkauf einer Ware oder eines Finanzinstruments zu einem bestimmten zukünftigen Datum zu einem Preis, der bei Beginn des Vertrags vom Käufer und Verkäufer vereinbart wurde. Jeder Futures-Vertrag hat Standardbedingungen in Bezug auf die Mindestmenge und Mindestqualität, die gekauft oder verkauft werden kann, den kleinsten Betrag, um den der Preis sich ändern kann, Lieferverfahren, Fälligkeit und andere Merkmale im Zusammenhang mit dem Vertrag.
6. ‚Option‘ bezeichnet einen Vertrag, der dem Eigentümer das Recht, aber nicht die Pflicht verleiht, ein spezifisches Finanzinstrument oder eine Ware zu einem vorab bestimmten Preis, einem Ausübungspreis, bzw. bis zu einem bestimmten zukünftigen Datum oder Ausübungsdatum, zu kaufen (call) oder zu verkaufen (put).
7. ‚Swap‘ bezeichnet einen Vertrag, in dem zwei Parteien vereinbaren, Cashflows in einem Finanzinstrument zu einem bestimmten zukünftigen Datum gegen Cashflows in einem anderen Finanzinstrument auszutauschen.
8. ‚Portfolio Swap‘ bezeichnet einen Vertrag, in dem die Endnutzer mehrfache Swaps durchführen können.

9. ‚Future‘ oder ‚Forward‘ bezeichnet einen Vertrag zum Kauf oder Verkauf einer Ware oder eines Finanzinstruments zu einem bestimmten zukünftigen Datum zu einem Preis, der bei Beginn des Vertrags vom Käufer und Verkäufer vereinbart wurde.

10. ‚Swaption‘ oder ‚Option auf einen Swap‘ bezeichnet einen Vertrag, der dem Inhaber das Recht, aber nicht die Pflicht gibt, einen Swap an oder bis zu einem bestimmten zukünftigen Datum oder Ausübungsdatum in der Zukunft abzuschließen.

11. ‚Future on a swap‘ bezeichnet einen Future-Vertrag, der den Inhaber verpflichtet, einen Swap an oder bis zu einem bestimmten Datum in der Zukunft abzuschließen.

12. ‚Forward on a swap‘ bezeichnet einen Forward-Vertrag, der den Inhaber verpflichtet, einen Swap an oder bis zu einem bestimmten zukünftigen Datum abzuschließen.

b) Abschnitt 2 Tabelle 2.2 erhält folgende Fassung:

„Tabelle 2.2

Anleihen (alle Anleihetypen mit Ausnahme von ETC und ETN) – Klassen, die keinen liquiden Markt haben

Für jede einzelne Anleihe wird festgestellt, dass sie gemäß Artikel 6a keinen liquiden Markt hat, wenn sie durch eine spezifische Kombination von Anleihemerkmale gekennzeichnet ist, wie in jeder Zeile der nachstehenden Tabellen angegeben.

Staatsanleihen und sonstige öffentliche Anleihen

Gruppen-ID	MiFIR-ID	Anleihetyp	Emittent oder Land des Emittenten	Restlaufzeit	Art des Kupons	Ausstehendes Emissionsvolumen
	RTS2#3	RTS2#9	Land des Emittenten, das im Feld ‚Kennung des Emittenten oder Handelsplatzbetreibers‘ nach Maßgabe der	Die verbleibende Zeit bis zum Datum der Fälligkeit, das im RTS23-Feld	Der dritte Buchstabe des CFI-Codes, der im RTS23-Feld ‚Klassifizierung	RTS23-Feld ‚Ausgegebener Gesamtnennbetrag‘, umgerechnet in EUR

			Delegierten Verordnung (EU) 2017/585 ⁶ der Kommission (im Folgenden „RTS23“) angegeben wurde.	„Fälligkeitstermin“ angegeben wurde.	des Instruments“ angegeben wurde.	
G1	BOND	EUSB EUSB bezeichnet eine Anleihe, bei der es sich weder um eine Wandelschuldverschreibung noch um eine gedeckte Schuldverschreibung handelt und die von einem öffentlichen Emittenten ausgegeben wird, bei dem es sich handeln kann um: a) die Union; b) einen Mitgliedstaat, einschließlich Ministerium, Agentur oder Zweckgesellschaft eines Mitgliedstaats; c) im Falle eines Mitgliedstaats, der als Bundesstaat organisiert ist, ein Mitglied des Bunds; d) eine für mehrere Mitgliedstaaten tätige Zweckgesellschaft; e) ein von zwei oder mehr Mitgliedstaaten errichtetes internationales Finanzinstitut, das dem Zweck dient, Finanzmittel zu mobilisieren und diejenigen seiner Mitglieder, die mit schwerwiegenden finanziellen Problemen konfrontiert oder von solchen bedroht sind, finanziell zu unterstützen; f) die Europäische Investitionsbank; g) eine	Bei dem Land des Emittenten handelt es sich um einen Mitgliedstaat, die Vereinigten Staaten oder das Vereinigte Königreich. ODER Der Emittent ist die Union. ODER Der Emittent ist die Europäische Investitionsbank. ODER Der Emittent ist ein internationales Finanzinstitut, das zwei	Bis einschließlich 10 Jahre	F (fester Kupon)	Weniger als 5 000 000 000 EUR

⁶ Delegierte Verordnung (EU) 2017/585 der Kommission vom 14. Juli 2016 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf technische Regulierungsstandards für die Datenstandards und -formate für die Referenzdaten für Finanzinstrumente und die technischen Maßnahmen in Bezug auf die von der ESMA und den zuständigen Behörden zu treffenden Vorkehrungen (ABl. L 87 vom 31.3.2017, S. 368, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2017/585/oj).

		öffentliche Einrichtung eines Drittlands.	oder mehrere Mitgliedstaaten zu dem Zweck errichtet haben, Finanzmittel zu mobilisieren und diejenigen seiner Mitglieder, die von schwerwiegenden Finanzierungsproblemen betroffen oder bedroht sind, finanziell zu unterstützen.			
G2	BOND	EUSB oder OEPB OEPB bezeichnet eine Anleihe, bei der es sich weder um eine Wandelschuldverschreibung noch um eine gedeckte Schuldverschreibung handelt und die von einer öffentlichen Einrichtung ausgegeben wird, die kein öffentlicher Emittent ist.	Alle Instrumente, die nicht unter G1 fallen			Weniger als 1 000 000 000 EUR

Unternehmensanleihen, Wandelschuldverschreibungen und sonstige Anleihen

Gruppen-ID	MiFIR-ID	Anleihetyp	Währung	Bonitätseinstufung	Ausstehendes Emissionsvolumen
	RTS2#3	RTS2#9	Währung des Instruments, die im RTS23-Feld ‚Nennwährung 1‘		RTS23-Feld ‚Ausgebener Gesamtnennbetrag‘, umgerechnet in EUR

			angegeben wird.		
G3	BOND	CRPB, CVTB oder OTHR CRPB bezeichnet eine Anleihe, bei der es sich weder um eine Wandelschuldverschreibung noch um eine gedeckte Schuldverschreibung handelt und die von einer <i>Societas Europaea</i> ausgegeben wird, die gemäß Verordnung (EG) Nr. 2157/2001 des Rates⁷ eingerichtet wurde, oder von einer Art von Gesellschaft gemäß den in Anhang I oder Anhang II der Richtlinie 2013/34/EU des Europäischen Parlaments und des Rates⁸ genannten Kategorien oder von einer gleichwertigen Gesellschaft in Drittländern. CVTB bezeichnet ein Instrument, das aus einer Anleihe oder einer verbrieften Schuldverschreibung mit eingebettetem Derivat besteht, wie eine Kaufoption der zugrunde liegenden Aktie.	EUR, GBP, USD	mit Investment-Grade-Rating	Weniger als 500 000 000 EUR
G4	BOND	CRPB, CVTB oder OTHR	Alle Instrumente, die nicht unter G3 fallen		Weniger als 500 000 000 EUR

Gedekte Schuldverschreibungen

Gruppen-ID	MiFIR-ID	Anleihetyp	Ausstehendes Emissionsvolumen
------------	----------	------------	-------------------------------

⁷ Verordnung (EG) Nr. 2157/2001 des Rates vom 8. Oktober 2001 über das Statut der Europäischen Gesellschaft (SE) (ABl. L 294 vom 10.11.2001, S. 1, ELI: <http://data.europa.eu/eli/reg/2001/2157/OJ>).

⁸ Richtlinie 2013/34/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 26. Juni 2013 über den Jahresabschluss, den konsolidierten Abschluss und damit verbundene Berichte von Unternehmen bestimmter Rechtsformen und zur Änderung der Richtlinie 2006/43/EG des Europäischen Parlaments und des Rates und zur Aufhebung der Richtlinien 78/660/EWG und 83/349/EWG des Rates (ABl. L 182 vom 29.6.2013, S. 19, ELI: <http://data.europa.eu/eli/dir/2013/34/OJ>).

	RTS2#3	RTS2#9	RTS23-Feld ‚Ausgebener Gesamtnennbetrag‘, umgerechnet in EUR
G5	BOND	CVDB CVDB bezeichnet eine Anleihe gemäß Artikel 52 Absatz 4 der Richtlinie 2009/65/EG	Weniger als 500 000 000 EUR

“

c) Die Abschnitte 4 bis 11 erhalten folgende Fassung:

„4. Börsengehandelte Derivate

Tabelle 4.1

Aktienderivate – Liquiditätsbestimmung, ADNA-Spannen, Vorhandels-LIS-Schwellenwert und Aufschubregelung

Klasse-ID	Klasse	Zur Bestimmung des Vorhandels-LIS und der Schwellenwerte für das Geschäftsvolumen wird jede Klasse weiter in die nachstehend definierten Unterklassen unterteilt.	Bestimmung der Liquidität	Spannen des durchschnittlichen täglichen Nennbetrags (ADNA)	Vorhandels-LIS-Schwellenwerte	Schwellenwerte für das Geschäftsvolumen (größer oder gleich)		
						Nachhandelsschwellenwerte für mittleres Volumen	Nachhandelsschwellenwerte für großes Volumen	Nachhandelsschwellenwerte für sehr großes Volumen
EQ1	Aktien-Index-Optionen	Eine Aktien-Index-Optionsunterklasse wird ausgehend von den folgenden Segmentierungskriterien definiert: Segmentierungskriterium 1 – zugrunde liegender	Liquide	ADNA < 100 Mio. EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				100 Mio. EUR ≤ ADNA < 200 Mio. EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR	60 000 000 EUR
				200 Mio. EUR ≤ ADNA < 600 Mio. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR	110 000 000 EUR

		Aktienindex		ADNA ≥ 600 Mio. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR	320 000 000 EUR
EQ2	Aktienindex-Futures	Eine Aktienindex-Future/Forward-Unterkategorie wird ausgehend von den folgenden Segmentierungskriterien definiert: Segmentierungskriterium 1 – zugrunde liegender Aktienindex	Liquide	ADNA < 100 Mio. EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				100 Mio. EUR ≤ ADNA < 1 Mrd. EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	11 000 000 EUR
				1 Mrd. EUR ≤ ADNA < 3 Mrd. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR	110 000 000 EUR
				3 Mrd. EUR ≤ ADNA < 5 Mrd. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR	320 000 000 EUR
				ADNA ≥ 5 Mrd. EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR	520 000 000 EUR
EQ3	Optionen auf Einzelaktien	Eine Aktienoptionsunterklasse wird ausgehend von den folgenden Segmentierungskriterien definiert: Segmentierungskriterium 1 – zugrunde liegende Aktie	Liquide	ADNA < 5 Mio. EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR	2 500 000 EUR
				5 Mio. EUR ≤ ADNA < 10 Mio. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				10 Mio. EUR ≤ ADNA < 20 Mio. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR	6 000 000 EUR
				ADNA ≥ 20 Mio. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	11 000 000 EUR
EQ4	Einzelaktien-Futures	Eine Aktien-Future/Forward-Unterkategorie wird ausgehend von den folgenden Segmentierungskriterien definiert: Segmentierungskriterium	Liquide	ADNA < 5 Mio. EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR	2 500 000 EUR
				5 Mio. EUR ≤ ADNA < 10 Mio. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				10 Mio. EUR ≤ ADNA < 20 Mio. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR	6 000 000 EUR

		1 – zugrunde liegende Aktie		ADNA ≥ 20 Mio. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	11 000 000 EUR
EQ5	Aktien- Dividenden- Optionen	Eine Aktien-Dividenden- Optionsunterklasse wird ausgehend von den folgenden Segmentierungskriterien definiert: Segmentierungskriterium 1 – zugrunde liegende Aktie, die Anspruch auf Dividenden gibt	Liquide	ADNA < 5 Mio. EUR	25 000 EUR	400 000 EUR	450 000 EUR	900 000 EUR
				5 Mio. EUR ≤ ADNA < 10 Mio. EUR	30 000 EUR	500 000 EUR	550 000 EUR	1 100 000 EUR
				10 Mio. EUR ≤ ADNA < 20 Mio. EUR	100 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				ADNA ≥ 20 Mio. EUR	150 000 EUR	2 000 000 EUR	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR
EQ6	Aktien- Dividenden- Futures	Eine Aktien-Dividenden- Future/Forward- Unterklasse wird ausgehend von den folgenden Segmentierungskriterien definiert: Segmentierungskriterium 1 – zugrunde liegende Aktie, die Anspruch auf Dividenden gibt	Liquide	ADNA < 5 Mio. EUR	25 000 EUR	400 000 EUR	450 000 EUR	900 000 EUR
				5 Mio. EUR ≤ ADNA < 10 Mio. EUR	30 000 EUR	500 000 EUR	550 000 EUR	1 100 000 EUR
				10 Mio. EUR ≤ ADNA < 20 Mio. EUR	100 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				ADNA ≥ 20 Mio. EUR	150 000 EUR	2 000 000 EUR	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR
EQ7	Dividendeninde- x-Optionen	Eine Dividendenindex- Optionsunterklasse wird ausgehend von den folgenden Segmentierungskriterien definiert: Segmentierungskriterium 1 – zugrunde liegender Dividendenindex	Liquide	ADNA < 100 Mio. EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				100 Mio. EUR ≤ ADNA < 200 Mio. EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR	60 000 000 EUR
				200 Mio. EUR ≤ ADNA < 600 Mio. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR	110 000 000 EUR
				ADNA ≥ 600 Mio. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR	320 000 000 EUR

EQ8	Dividendenindex-Futures	Eine Dividendenindex-Future/Forward-Unterklasse wird ausgehend von den folgenden Segmentierungskriterien definiert: Segmentierungskriterium 1 – zugrunde liegender Dividendenindex	Liquide	ADNA < 100 Mio. EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				100 Mio. EUR ≤ ADNA < 1 Mrd. EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	11 000 000 EUR
				1 Mrd. EUR ≤ ADNA < 3 Mrd. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR	110 000 000 EUR
				3 Mrd. EUR ≤ ADNA < 5 Mrd. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR	320 000 000 EUR
				ADNA ≥ 5 Mrd. EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR	520 000 000 EUR
EQ9	Volatilitäts-Index-Optionen	Eine Volatilitäts-Index-Optionsunterklasse wird ausgehend von den folgenden Segmentierungskriterien definiert: Segmentierungskriterium 1 – zugrunde liegender Volatilitätsindex	Liquide	ADNA < 100 Mio. EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				100 Mio. EUR ≤ ADNA < 200 Mio. EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR	60 000 000 EUR
				200 Mio. EUR ≤ ADNA < 600 Mio. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR	110 000 000 EUR
				ADNA ≥ 600 Mio. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR	320 000 000 EUR
EQ10	Volatilitätsindex-Futures	Eine Volatilitätsindex-Future/Forward-Unterklasse wird ausgehend von den folgenden Segmentierungskriterien definiert: Segmentierungskriterium 1 – zugrunde liegender Volatilitätsindex	Liquide	ADNA < 100 Mio. EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				100 Mio. EUR ≤ ADNA < 1 Mrd. EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	11 000 000 EUR
				1 Mrd. EUR ≤ ADNA < 3 Mrd. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR	110 000 000 EUR
				3 Mrd. EUR ≤ ADNA < 5 Mrd. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR	320 000 000 EUR

				ADNA ≥ 5 Mrd. EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR	520 000 000 EUR
EQ11	ETF-Optionen	Eine ETF-Optionsunterklasse wird ausgehend von den folgenden Segmentierungskriterien definiert: Segmentierungskriterium 1 – zugrunde liegender ETF	Liquide	ADNA < 5 Mio. EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR	2 500 000 EUR
				5 Mio. EUR ≤ ADNA < 10 Mio. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				10 Mio. EUR ≤ ADNA < 20 Mio. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR	6 000 000 EUR
				ADNA ≥ 20 Mio. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	11 000 000 EUR
EQ12	ETF-Futures	Eine ETF-Future/Forward-Unterklasse wird ausgehend von den folgenden Segmentierungskriterien definiert: Segmentierungskriterium 1 – zugrunde liegender ETF	Liquide	ADNA < 5 Mio. EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR	2 500 000 EUR
				5 Mio. EUR ≤ ADNA < 10 Mio. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR	3 000 000 EUR
				10 Mio. EUR ≤ ADNA < 20 Mio. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR	6 000 000 EUR
				ADNA ≥ 20 Mio. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	11 000 000 EUR
EQ13	Swaps		Illiquide		25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR	300 000 EUR
EQ14	Portfolio Swaps		Illiquide		25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR	300 000 EUR
EQ15	Sonstige Aktienderivate		Illiquide		25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR	300 000 EUR
Aufschubdauer						Tagesschluss	T + 1	T + 2

Tabelle 4.2
Zinsderivate – Bestimmung der Liquidität, Vorhandels-LIS-Schwellenwert und Aufschubregelung

Klasse-ID	Klasse	Bestimmung der Liquidität	Vorhandels-LIS-Schwellenwerte	Schwellenwerte für das Geschäftsvolumen (größer oder gleich)		
				Nachhandelsschwellenwerte für mittleres Volumen	Nachhandelsschwellenwerte für großes Volumen	Nachhandelsschwellenwerte für sehr großes Volumen
IR01	BOBL-Futures	Liquide	500 000 EUR	1 000 000 EUR	5 000 000 EUR	10 000 000 EUR
IR02	BUND-Futures	Liquide	250 000 EUR	500 000 EUR	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR
IR03	BUXL-Futures	Liquide	250 000 EUR	500 000 EUR	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR
IR04	Schatz-Futures	Liquide	1 000 000 EUR	2 000 000 EUR	10 000 000 EUR	20 000 000 EUR
IR05	Euro-OAT-Futures	Liquide	250 000 EUR	500 000 EUR	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR
IR06	Langfristige Euro-BTP-Futures	Liquide	250 000 EUR	500 000 EUR	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR
IR07	Kurzfristige Euro-BTP-Futures	Liquide	500 000 EUR	1 000 000 EUR	5 000 000 EUR	10 000 000 EUR
IR08	Dreimonats-Euro-STR-Futures	Liquide	1 250 000 EUR	2 500 000 EUR	12 500 000 EUR	25 000 000 EUR
IR09	Optionen auf BOBL-Futures	Liquide	1 250 000 EUR	2 500 000 EUR	3 750 000 EUR	5 000 000 EUR
IR10	Optionen auf BUND-Futures	Liquide	2 750 000 EUR	5 500 000 EUR	8 250 000 EUR	11 000 000 EUR
IR11	Sonstige Zinsderivate	Illiquide	50 000 EUR	100 000 EUR	500 000 EUR	1 000 000 EUR
Aufschubdauer				Tagesschluss	T + 1	T + 2

Tabelle 4.3
Waren- und Emissionszertifikatderivate – Bestimmung der Liquidität, Vorhandels-LIS-Schwellenwert und Aufschubregelung

Klasse-ID	Klasse	Bestimmung der Liquidität	Vorhandels-LIS-Schwellenwerte	Schwellenwerte für das Geschäftsvolumen (größer oder gleich)		
				Nachhandelsschwellenwerte für mittleres Volumen	Nachhandelsschwellenwerte für großes Volumen	Nachhandelsschwellenwerte für sehr großes Volumen
AG01	Mahlweizen-Futures	Liquide	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	2 000 000 EUR
AG02	Raps-Futures	Liquide	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	2 000 000 EUR
AG03	Mais-Futures	Liquide	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	2 000 000 EUR
EA01	Futures auf Emissionszertifikate der Europäischen Union	Liquide	50 000 Tonnen Kohlendioxidäquivalent	100 000 Tonnen Kohlendioxidäquivalent	150 000 Tonnen Kohlendioxidäquivalent	200 000 Tonnen Kohlendioxidäquivalent
EL01	Deutsche Strom-Futures (monatliche Grundlast)	Liquide	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	2 000 000 EUR
EL02	Französische Strom-Futures (monatliche Grundlast)	Liquide	250 000 EUR	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
EL03	Italienische Strom-Futures (monatliche Grundlast)	Liquide	250 000 EUR	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
EL04	Nordische Strom-Futures (monatliche Grundlast)	Liquide	250 000 EUR	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
EL05	Spanische Strom-Futures (monatliche Grundlast)	Liquide	250 000 EUR	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
EL06	Niederländische Strom-Futures (monatliche Grundlast)	Liquide	250 000 EUR	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR

EL07	Ungarische Strom-Futures (monatliche Grundlast)	Liquide	250 000 EUR	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
NG01	Niederländische TTF-Gas-Futures (monatlich)	Liquide	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	2 000 000 EUR
NG02	Deutsche THE-Gas-Futures (monatlich)	Liquide	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	2 000 000 EUR
NG03	Optionen auf niederländische TTF-Gas-Futures (monatlich)	Liquide	500 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	2 000 000 EUR
Aufschubdauer				Tagesschluss	T + 1	T + 2

Klasse-ID	Klasse	Bestimmung der Liquidität	Vorhandels-LIS-Schwellenwerte	Nachhandelsschwellenwerte für mittleres / großes / sehr großes Volumen (größer oder gleich)
	Sonstige Waren- und Emissionszertifikatderivate	Illiquide	100 000 EUR	200 000 EUR
Aufschubdauer				T + 2

Tabelle 4.4
Kreditderivate – Bestimmung der Liquidität, Vorhandels-LIS-Schwellenwert und Aufschubregelung

Klasse-ID	Klasse	Bestimmung der Liquidität	Vorhandels-LIS-Schwellenwert	Nachhandelsschwellenwerte für mittleres / großes / sehr großes Volumen (größer oder gleich)
CR01	Kreditderivate	Illiquide	5 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Aufschubdauer				T + 2

Tabelle 4.5
Devisenderivate – Bestimmung der Liquidität, Vorhandels-LIS-Schwellenwert und Aufschubregelung

Klasse-ID	Klasse	Bestimmung der Liquidität	Vorhandels-LIS-Schwellenwert	Nachhandelsschwellenwerte für mittleres / großes / sehr großes Volumen (größer oder gleich)
FX01	Devisenderivate	Illiquide	12 500 000 EUR	25 000 000 EUR
Aufschubdauer				T + 2

Tabelle 4.6
Verbriefte Derivate – Bestimmung der Liquidität, Vorhandels-LIS-Schwellenwert und Aufschubregelung

Klasse-ID	Klasse	Bestimmung der Liquidität	Vorhandels-LIS-Schwellenwert	Schwellenwerte für das Geschäftsvolumen (größer oder gleich)		
				Nachhandelsschwellenwerte für mittleres Volumen	Nachhandelsschwellenwerte für großes Volumen	Nachhandelsschwellenwerte für sehr großes Volumen
SD01	Verbriefte Derivate	Liquide	50 000 EUR	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

Aufschubdauer				Tagesschluss	T + 1	T + 2
---------------	--	--	--	--------------	-------	-------

Tabelle 4.7

Andere Derivate – Bestimmung der Liquidität, Vorhandels-LIS-Schwellenwert und Aufschubregelung

Klasse-ID	Klasse	Bestimmung der Liquidität	Vorhandels-LIS-Schwellenwert	Nachhandelsschwellenwerte für mittleres / großes / sehr großes Volumen (größer oder gleich)
OT01	Sonstige Derivate	Illiquide	50 000 EUR	100 000 EUR
Aufschubdauer				T + 2

5. OTC-Derivate im Sinne von Artikel 8a Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014

Tabelle 5.1

Kreditausfallswaps, die in den Anwendungsbereich von Artikel 8a Absatz 2 Buchstabe a der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 fallen – Bestimmung der Liquidität, Vorhandels-LIS-Schwellenwert und Aufschubregelung

Kreditausfallswaps, die in den Anwendungsbereich von Artikel 8a Absatz 2 Buchstabe a der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 fallen	Merkmal	Bestimmung der Liquidität	Vorhandels-LIS-Schwellenwerte	Schwellenwerte für das Geschäftsvolumen (größer oder gleich)		
				Nachhandelsschwellenwerte für mittleres Volumen	Nachhandelsschwellenwerte für großes Volumen	Nachhandelsschwellenwerte für sehr großes Volumen
iTraxx Europe Main	5Y On-the-Run und First Off-	Liquide	15 000 000 EUR	30 000 000 EUR	50 000 000 EUR	500 000 000 EUR

iTraxx Europe Crossover	the-Run	Liquide	5 000 000 EUR	10 000 000 EUR	30 000 000 EUR	200 000 000 EUR
Aufschubdauer für die Volumenveröffentlichung				15 Minuten	Tagesschluss	Drei Monate
Aufschubdauer für die Preisveröffentlichung				15 Minuten	15 Minuten	15 Minuten
Sonstige Kreditausfallswaps, die in den Anwendungsbereich von Artikel 8a Absatz 2 Buchstabe a der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 fallen	Alle	Illiquide	5 000 000 EUR	10 000 000 EUR	30 000 000 EUR	200 000 000 EUR
Aufschubdauer für die Volumenveröffentlichung				Eine Woche	Zwei Wochen	Drei Monate
Aufschubdauer für die Preisveröffentlichung				Tagesschluss	Tagesschluss	Tagesschluss

Tabelle 5.2

Zinsderivate im Sinne von Artikel 8a Absatz 2 Buchstabe a der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 – Bestimmung der Liquidität, Vorhandels-LIS-Schwellenwert und Aufschubregelung

Klasse – Fixed-to-Float-EURIBOR				
Laufzeit (Jahre)	Bestimmung der Liquidität	Vorhandels-LIS-Schwellenwerte	Schwellenwerte für das Geschäftsvolumen (größer oder gleich)	
			Nachhandelsschwellenwerte für mittleres Volumen	Nachhandelsschwellenwerte für großes / sehr großes Volumen
1	Liquide	200 000 000 EUR	400 000 000 EUR	750 000 000 EUR
2	Liquide	125 000 000 EUR	250 000 000 EUR	400 000 000 EUR

3	Liquide	100 000 000 EUR	200 000 000 EUR	400 000 000 EUR
5	Liquide	50 000 000 EUR	100 000 000 EUR	200 000 000 EUR
7	Liquide	50 000 000 EUR	100 000 000 EUR	200 000 000 EUR
10	Liquide	37 500 000 EUR	75 000 000 EUR	100 000 000 EUR
12	Liquide	37 500 000 EUR	75 000 000 EUR	100 000 000 EUR
15	Liquide	37 500 000 EUR	75 000 000 EUR	100 000 000 EUR
20	Liquide	25 000 000 EUR	50 000 000 EUR	100 000 000 EUR
25	Liquide	25 000 000 EUR	50 000 000 EUR	100 000 000 EUR
30	Liquide	15 000 000 EUR	30 000 000 EUR	50 000 000 EUR
Aufschubdauer für die Volumenveröffentlichung			Tagesschluss	Drei Monate
Aufschubdauer für die Preisveröffentlichung			Tagesschluss	Tagesschluss

Klasse – OIS-FedFunds				
Laufzeit (Jahre)	Bestimmung der Liquidität	Vorhandels-LIS- Schwellenwerte	Schwellenwerte für das Geschäftsvolumen (größer oder gleich)	
			Nachhandelsschwellenwerte für mittleres Volumen	Nachhandelsschwellenwerte für großes / sehr großes Volumen
1	Illiquide	125 000 000 USD	250 000 000 USD	400 000 000 USD
2	Illiquide	75 000 000 USD	150 000 000 USD	250 000 000 USD
3	Illiquide	50 000 000 USD	100 000 000 USD	200 000 000 USD
Aufschubdauer für die Volumenveröffentlichung			T + 1	Drei Monate
Aufschubdauer für die Preisveröffentlichung			T + 1	T + 1

Klasse – OIS-SOFR				
Laufzeit (Jahre)	Bestimmung der Liquidität	Vorhandels-LIS-Schwellenwerte	Schwellenwerte für das Geschäftsvolumen (größer oder gleich)	
			Nachhandelsschwellenwerte für mittleres Volumen	Nachhandelsschwellenwerte für großes / sehr großes Volumen
1	Liquide	125 000 000 USD	250 000 000 USD	500 000 000 USD
2	Liquide	75 000 000 USD	150 000 000 USD	250 000 000 USD
3	Liquide	50 000 000 USD	100 000 000 USD	200 000 000 USD
5	Liquide	50 000 000 USD	100 000 000 USD	150 000 000 USD
7	Liquide	37 500 000 USD	75 000 000 USD	150 000 000 USD
10	Liquide	25 000 000 USD	50 000 000 USD	75 000 000 USD
12	Liquide	25 000 000 USD	50 000 000 USD	75 000 000 USD
15	Liquide	25 000 000 USD	50 000 000 USD	75 000 000 USD
20	Liquide	25 000 000 USD	50 000 000 USD	75 000 000 USD
25	Liquide	25 000 000 USD	50 000 000 USD	75 000 000 USD
30	Liquide	15 000 000 USD	30 000 000 USD	50 000 000 USD
Aufschubdauer für die Volumenveröffentlichung			Tagesschluss	Drei Monate
Aufschubdauer für die Preisveröffentlichung			Tagesschluss	Tagesschluss

Klasse – OIS-SONIA				
--------------------	--	--	--	--

Laufzeit (Jahre)	Bestimmung der Liquidität	Vorhandels-LIS-Schwellenwerte	Schwellenwerte für das Geschäftsvolumen (größer oder gleich)	
			Nachhandelsschwellenwerte für mittleres Volumen	Nachhandelsschwellenwerte für großes / sehr großes Volumen
1	Liquide	87 500 000 GBP	175 000 000 GBP	355 000 000 GBP
2	Liquide	67 500 000 GBP	135 000 000 GBP	175 000 000 GBP
3	Liquide	67 500 000 GBP	135 000 000 GBP	175 000 000 GBP
5	Liquide	32 500 000 GBP	65 000 000 GBP	90 000 000 GBP
7	Liquide	32 500 000 GBP	65 000 000 GBP	90 000 000 GBP
10	Liquide	22 500 000 GBP	45 000 000 GBP	65 000 000 GBP
12	Liquide	22 500 000 GBP	45 000 000 GBP	65 000 000 GBP
15	Liquide	22 500 000 GBP	45 000 000 GBP	65 000 000 GBP
20	Liquide	22 500 000 GBP	45 000 000 GBP	65 000 000 GBP
25	Liquide	22 500 000 GBP	45 000 000 GBP	65 000 000 GBP
30	Liquide	10 000 000 GBP	20 000 000 GBP	25 000 000 GBP
Aufschubdauer für die Volumenveröffentlichung			Tagesschluss	Drei Monate
Aufschubdauer für die Preisveröffentlichung			Tagesschluss	Tagesschluss

Klasse – OIS-TONA				
Laufzeit (Jahre)	Bestimmung der Liquidität	Vorhandels-LIS-Schwellenwerte	Schwellenwerte für das Geschäftsvolumen (größer oder gleich)	

			Nachhandelsschwellenwerte für mittleres Volumen	Nachhandelsschwellenwerte für großes / sehr großes Volumen
1	Liquide	17 500 000 000 JPY	35 000 000 000 JPY	55 000 000 000 JPY
2	Liquide	10 000 000 000 JPY	20 000 000 000 JPY	30 000 000 000 JPY
3	Liquide	10 000 000 000 JPY	20 000 000 000 JPY	30 000 000 000 JPY
5	Liquide	5 000 000 000 JPY	10 000 000 000 JPY	15 000 000 000 JPY
7	Liquide	5 000 000 000 JPY	10 000 000 000 JPY	15 000 000 000 JPY
10	Liquide	3 500 000 000 JPY	7 000 000 000 JPY	10 000 000 000 JPY
12	Liquide	3 500 000 000 JPY	7 000 000 000 JPY	10 000 000 000 JPY
15	Liquide	2 500 000 000 JPY	5 000 000 000 JPY	7 000 000 000 JPY
20	Liquide	1 500 000 000 JPY	3 000 000 000 JPY	5 000 000 000 JPY
25	Liquide	1 500 000 000 JPY	3 000 000 000 JPY	5 000 000 000 JPY
30	Liquide	1 500 000 000 JPY	3 000 000 000 JPY	5 000 000 000 JPY
Aufschubdauer für die Volumenveröffentlichung			Tagesschluss	Drei Monate
Aufschubdauer für die Preisveröffentlichung			Tagesschluss	Tagesschluss

Klasse – OIS-EuroSTR				
Laufzeit (Jahre)	Bestimmung der Liquidität	Vorhandels-LIS- Schwellenwerte	Schwellenwerte für das Geschäftsvolumen (größer oder gleich)	
			Nachhandelsschwellenwerte für mittleres Volumen	Nachhandelsschwellenwerte für großes / sehr großes Volumen
1	Liquide	150 000 000 EUR	300 000 000 EUR	750 000 000 EUR
2	Liquide	100 000 000 EUR	200 000 000 EUR	300 000 000 EUR

3	Liquide	100 000 000 EUR	200 000 000 EUR	300 000 000 EUR
Aufschubdauer für die Volumenveröffentlichung			Tagesschluss	Drei Monate
Aufschubdauer für die Preisveröffentlichung			Tagesschluss	Tagesschluss

Tabelle 5.3

Einzeladressen-Kreditausfallswaps im Sinne von Artikel 8a Absatz 2 Buchstabe b der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 – Bestimmung der Liquidität, Vorhandels-LIS-Schwellenwert und Aufschubregelung

Klasse – Einzeladressen-Kreditausfallswaps im Sinne von Artikel 8a Absatz 2 Buchstabe b der Verordnung (EU) Nr. 600/2014					
Laufzeit (Jahre)	Bestimmung der Liquidität	Vorhandels-LIS-Schwellenwerte	Schwellenwerte für das Geschäftsvolumen (größer oder gleich)		
			Nachhandelsschwellenwert für mittleres Volumen	Nachhandelsschwellenwert für großes Volumen	Nachhandelsschwellenwert für sehr großes Volumen
5	Illiquide	500 000 EUR	1 000 000 EUR	5 000 000 EUR	50 000 000 EUR
Aufschubdauer für die Volumenveröffentlichung			T + 1	Zwei Wochen	Drei Monate
Aufschubdauer für die Preisveröffentlichung			T + 1	T + 1	T + 1
Sonstige Laufzeiten	Illiquide	500 000 EUR	1 000 000 EUR	5 000 000 EUR	50 000 000 EUR
Aufschubdauer für die Volumenveröffentlichung			Eine Woche	Zwei Wochen	Drei Monate
Aufschubdauer für die Preisveröffentlichung			Eine Woche	Eine Woche	Eine Woche

Tabelle 5.4
Kreditausfallswaps im Sinne von Artikel 8a Absatz 2 Buchstabe c der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 – Bestimmung der Liquidität, Vorhandels-LIS-Schwellenwert und Aufschubregelung

Kreditausfallswaps mit Referenz auf einen Index, der global systemrelevante Banken umfasst	Merkmal	Bestimmung der Liquidität	Vorhandels-LIS-Schwellenwerte	Schwellenwerte für das Geschäftsvolumen (größer oder gleich)		
				Nachhandelsschwellenwerte für mittleres Volumen	Nachhandelsschwellenwerte für großes Volumen	Nachhandelsschwellenwerte für sehr großes Volumen
iTraxx Europe Senior Financials	5Y On-the-Run und First Off-the-Run	Illiquide	15 000 000 EUR	30 000 000 EUR	50 000 000 EUR	300 000 000 EUR
iTraxx Europe Subordinate Financial		Illiquide	5 000 000 EUR	10 000 000 EUR	30 000 000 EUR	200 000 000 EUR
Aufschubdauer für die Volumenveröffentlichung				Eine Woche	Zwei Wochen	Drei Monate
Aufschubdauer für die Preisveröffentlichung				15 Minuten	15 Minuten	Tagesschluss
Sonstige Kreditausfallswaps mit Referenz auf einen in Artikel 8a Absatz 2 Buchstabe c der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 genannten Index	Alle	Illiquide	5 000 000 EUR	10 000 000 EUR	30 000 000 EUR	200 000 000 EUR
Aufschubdauer für die Volumenveröffentlichung				Eine Woche	Zwei Wochen	Drei Monate
Aufschubdauer für die Preisveröffentlichung				Tagesschluss	Tagesschluss	Tagesschluss

“

d) Abschnitt 13 wird gestrichen.

ANHANG II

Anhang II der Delegierten Verordnung (EU) 2025/1155 wird wie folgt geändert:

1. Die Überschrift erhält folgende Fassung:

„Aufsichtsrechtliche Daten und zentrale Nachhandelsmarktdaten, die gemäß den Artikeln 5, 6, 6a, 7, 8 und 8a an den CTP für Schuldverschreibungen, den CTP für Aktien und börsengehandelte Fonds und den CTP für OTC-Derivate zu übermitteln und von diesen zu verbreiten sind“
2. Die Überschrift von Tabelle 1 erhält folgende Fassung:

„In den Tabellen 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9 und 10 verwendete Zeichen“
3. Die folgenden Tabellen 8, 9 und 10 werden angefügt:

„Tabelle 8

Aufsichtsrechtliche Daten für OTC-Derivate, nach Instrument

#	Feldname	Beschreibung	Format Abhängig von der für die Datenübermittlung verwendeten Syntax können gleichwertige Formate verwendet werden.	Input-/Outputdatenfeld
1	Kennung des Instruments	Code zur Identifizierung des Finanzinstruments.	Die Identifizierung des Finanzinstruments erfolgt gemäß der Delegierten Verordnung (EU) 2025/1003 der Kommission.	Beides
2	Instrumentstatus – Datum und Uhrzeit des Beginns	Datum und Uhrzeit, ab dem bzw. der der Instrumentstatus gültig ist Die Granularität muss den Anforderungen des Artikels 12 entsprechen.	{DATE_TIME_FORMAT}	Beides
3	Währung	Hauptwährung, in der das Instrument gehandelt wird	{CURRENCYCODE_3}	Beides
4	Datum und Uhrzeit der Verbreitung	Datum und Uhrzeit der Verbreitung des Instrumentstatus durch den CTP Die Granularität muss den Anforderungen des Artikels 15 entsprechen.	{DATE_TIME_FORMAT}	Output
5	Instrumentstatus	Beschreibung des Status des Finanzinstruments. Der Status des Finanzinstruments muss einer	„SUSP“ – Instrument ist von einer Aussetzung	Beides

#	Feldname	Beschreibung	Format Abhängig von der für die Datenübermittlu ng verwendeten Syntax können gleichwertige Formate verwendet werden.	Input- /Outputdatenfeld
		der folgenden sein: 1) Handel ausgesetzt an dem im Feld ‚Handelsplatz‘ angegebenen Handelsplatz gemäß Artikel 32 der Richtlinie 2014/65/EU 2) Vom Handel ausgeschlossen an dem im Feld ‚Handelsplatz‘ angegebenen Handelsplatz gemäß Artikel 32 der Richtlinie 2014/65/EU 3) Betroffen von einem Handelsstopp an dem im Feld ‚Handelsplatz‘ angegebenen Handelsplatz gemäß Artikel 18 Absatz 5 der Richtlinie 2014/65/EU 4) Steht nach einer Aussetzung, einem Ausschluss oder einem Handelsstopp wieder für den Handel zur Verfügung.	betroffen ‚REMOV‘ – Instrument ist von einem Ausschluss betroffen ‚HALT‘ – Instrument ist von einem Handelsstopp betroffen ‚ACTV‘ – Instrument steht nach einer Aussetzung, einem Ausschluss oder einem Handelsstopp wieder zum Handel zur Verfügung	
6	Handelsplatz	Angabe des Handelsplatzes, an dem der Instrumentstatus gültig ist (Segment MIC, sofern verfügbar, ansonsten Operating MIC). Der Handelsplatz ist ein MTF oder ein OTF.	{MIC}	Beides
7	Handelssystem	Art des Handelssystems, über das das Instrument gehandelt wird	‚CLOB‘ – Zentrales Limit-Orderbuch ‚QDTS‘ – Quotierungsgetriebener Markt ‚PATS‘ – Periodische Auktion ‚RFQT‘ – Preisanfrage ‚VOIC‘ – Sprachbasiertes System ‚HYBR‘ –	Beides

#	Feldname	Beschreibung	Format Abhängig von der für die Datenübermittlu ng verwendeten Syntax können gleichwertige Formate verwendet werden.	Input- /Outputdatenfeld
			Hybrides System ,OTHR‘ – Sonstiges	

Tabelle 9
**Aufsichtsrechtliche Daten für OTC-Derivate, nach System für das Zusammenführen
von Aufträgen**

#	Feldname	Beschreibung	Format Abhängig von der für die Datenübermittlu ng verwendeten Syntax können gleichwertige Formate verwendet werden.	Input- /Outputdatenfeld
1	Handelsplatz	Angabe des Handelsplatzes, an dem der Status des Systems für das Zusammenführen von Aufträgen gültig ist (Segment MIC, sofern verfügbar, ansonsten Operating MIC). Der Handelsplatz ist ein MTF oder ein OTF.	{MIC}	Beides
2	Handelssystem	Art des Handelssystems, über das der Systemstatus bereitgestellt wird	,CLOB‘ – Zentrales Limit- Orderbuch ,QDTS‘ – Quotierungsgetri ebener Markt ,PATS‘ – Periodische Auktion ,RFQT‘ – Preisanfrage ,VOIC‘ – Sprachbasiertes System ,HYBR‘ – Hybrides System ,OTHR‘ –	Beides

			Sonstiges	
3	Systemstatus – Datum und Uhrzeit des Beginns	Datum und Uhrzeit, ab dem bzw. der der Systemstatus gültig ist Die Granularität muss den Anforderungen des Artikels 12 entsprechen.	{DATE_TIME_FORMAT}	Beides
4	Datum und Uhrzeit der Verbreitung	Datum und Uhrzeit der Verbreitung des Systemstatus durch den CTP. Die Granularität muss den Anforderungen des Artikels 15 entsprechen.	{DATE_TIME_FORMAT}	Output
5	Handelssystemstatus	Status des Handelssystems, über das das Instrument gehandelt wird.	,ACTV‘ – System aktiv ,OTAG‘ – Handelssystem ausgefallen ,POTG‘ – Handelssystem teilweise ausgefallen	Beides

Tabelle 10
Zentrale Nachhandelsmarktdaten für OTC-Derivate

#	Feldname	Beschreibung und zu veröffentlichende Einzelheiten	Art des Ausführungs- oder Veröffentlichungsplatzes	Nach den Vorgaben in Tabelle 1 einzuhaltendes Format Abhängig von der für die Datenübermittlung verwendeten Syntax können gleichwertige Formate verwendet	Input-/Output datenfeld
---	----------	--	--	--	-------------------------

				werden.	
1	Handelsdatum und -zeit	Tabelle 2 Feld 1 in Anhang II der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583.			Beides
2	Kennung des Instruments	Tabelle 2 Feld 2 in Anhang II der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583.			Beides
3	Geltungsbeginn	Tabelle 2 Feld 2a in Anhang II der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583.			Beides
4	Fälligkeit	Tabelle 2 Feld 2b in Anhang II der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583.			Beides
5	Preis	Tabelle 2 Feld 3 in Anhang II der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583.			Beides
6	Fehlender Preis	Tabelle 2 Feld 4 in Anhang II der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583			Beides
7	Preiswährung	Tabelle 2 Feld 5 in Anhang II der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583.			Beides
8	Preisangabe	Tabelle 2 Feld 6 in Anhang II der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583.			Beides
9	Menge	Tabelle 2 Feld 7 in Anhang II der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583.			Beides
10	Nennbetrag	Tabelle 2 Feld 10 in Anhang II der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583.			Beides
11	Nennwährung	Tabelle 2 Feld 11 in Anhang II der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583.			Beides
12	Ausführungsplatz	Tabelle 2 Feld 13 in Anhang II der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583.			Beides
13	Handelsplatz der Ausführung im Drittland	Tabelle 2 Feld 14 in Anhang II der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583.			Beides
14	Datum und Uhrzeit des Eingangs der Daten beim Datenkontributor	Datum und Uhrzeit des Eingangs der Transaktionsmeldung bei einem APA. Die Granularität muss den Anforderungen des Artikels 15	APA	{DATE_TIME_FORMAT}	Input

		entsprechen.			
15	Datum und Uhrzeit der Veröffentlichung des Geschäfts durch den Datenkontributor	Tabelle 2 Feld 15 in Anhang II der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583.			Beides
16	Veröffentlichungsplatz	Tabelle 2 Feld 16 in Anhang II der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583.			Beides
17	Transaktionsidentifikationscode	Tabelle 2 Feld 17 in Anhang II der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583.			Beides
18	Datum und Uhrzeit des Eingangs beim CTP	Datum und Uhrzeit des Eingangs des Geschäfts beim CTP. Die Granularität muss den Anforderungen des Artikels 15 entsprechen.	CTP	{DATE_TIME_FORMAT}	Output
19	Datum und Uhrzeit der Veröffentlichung durch den CTP	Datum und Uhrzeit der Veröffentlichung des Geschäfts durch den CTP. Die Granularität muss den Anforderungen des Artikels 15 entsprechen.	CTP	{DATE_TIME_FORMAT}	Output
20	Kennzeichen	Tabelle 2 Feld 19 in Anhang II der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583.			Beides
21	Kennzeichnung verdächtiger Daten	Vom CTP einzutragende Kennzeichnung zur Datenqualität, wenn das APA oder der CTP Geschäfte ermittelt haben, die ihrer Ansicht nach Probleme in Bezug auf die Datenqualität aufweisen könnten.	CTP	TRUE oder FALSE	Output
22	Art des Handelssystems	Tabelle 2 Feld 20 in Anhang II der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583.			Beides

“

(1)

ANHANG III

In Anhang IV der Delegierten Verordnung (EU) 2025/1155 erhält Tabelle 2 folgende Fassung:

„Tabelle 2
Grad an Genauigkeit für Mitglieder, Teilnehmer oder Nutzer eines Handelsplatzes

Art der Handelstätigkeit	Beschreibung	Maximal zulässige Abweichung von der UTC	Granularität des Zeitstempels
Tätigkeit unter Verwendung einer hochfrequenten algorithmischen Handelstechnik	Hochfrequente algorithmische Handelstechnik	100 Mikrosekunden	0,1 Mikrosekunde oder feiner
Tätigkeit unter Verwendung sprachbasierter Handelssysteme	Sprachbasierte Handelssysteme im Sinne des Anhangs II Tabelle 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583.	1 Sekunde	1 Sekunde oder feiner
Tätigkeit unter Verwendung von Preisanfragesystemen, deren Antworten menschliches Eingreifen voraussetzen oder die keinen algorithmischen Handel zulassen	Preisanfragesysteme im Sinne des Anhangs II Tabelle 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/583.	1 Sekunde	1 Sekunde oder feiner
Tätigkeit unter Verwendung von Systemen zur Formalisierung ausgehandelter Geschäfte	Ausgehandelte Geschäfte im Sinne von Artikel 4 Absatz 1 Buchstabe b der Verordnung (EU) Nr. 600/2014.	1 Sekunde	1 Sekunde oder feiner
Sonstige Handelstätigkeiten	Alle sonstigen, in dieser Tabelle nicht aufgeführten Handelstätigkeiten	1 Millisekunde	1 Millisekunde oder feiner

“