



Richtlinien (Geldmarktstatistik)

Gültig ab: **01.04.2022**

Änderungen zur Vorversion sind in **roter Schrift** gekennzeichnet.

1. EINLEITUNG.....	4
2. ALLGEMEINE ANFORDERUNGEN	4
2.1 GEGENSTAND DER ERHEBUNG UND BEGRIFFSBESTIMMUNGEN.....	4
2.1.1 <i>Geldmarktsegmente.....</i>	4
2.1.2 <i>Umfang der Berichterstattung.....</i>	6
2.1.3 <i>Definition von Geschäften mit nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften.....</i>	7
2.2 ERLÄUTERUNGEN ZUR DATENÜBERTRAGUNG.....	7
2.2.1 <i>Einreichungsfrist und Richtigkeit der Daten.....</i>	7
2.2.2 <i>Datenübertragung.....</i>	7
2.2.3 <i>Unique Transaction Identifier.....</i>	9
2.2.4 <i>Korrekturen.....</i>	9
2.2.5 <i>Neuverhandlungen.....</i>	11
2.2.6 <i>Novations.....</i>	11
2.3 KONZEPTIONELLE RAHMENSTRUKTUR.....	12
2.3.1 <i>Konzeptionelle Struktur des Business Application Header.....</i>	13
2.3.2 <i>Konzeptionelle Struktur des Reporting Header.....</i>	14
2.3.3 <i>Konzeptionelle Definition einer Fehlanzeige.....</i>	14
3. KONZEPTIONELLE DEFINITIONEN FÜR DAS BESICHERTE MARKTSEGMENT	15
3.1 MELDUNG VON OPEN REPOS, EVERGREENS UND EXTENDIBLE REPOS	16
3.1.1 <i>Open Repos mit Overnight Maturity.....</i>	16
3.1.2 <i>Open Repos mit Kündigungsfrist (Open Evergreens).....</i>	18
3.1.3 <i>Fixed-Term Evergreens.....</i>	21
3.1.4 <i>Extendible Repos.....</i>	24
3.2 MELDUNG VON WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTEN GEGEN CASH.....	25
3.2.1 <i>Wertpapierleihe ohne feste Laufzeit mit Overnight Maturity.....</i>	25
3.2.2 <i>Wertpapierleihe ohne feste Laufzeit mit Kündigungsfrist.....</i>	26
3.3 ERLÄUTERUNGEN DER ZU MELDENDEN VARIABLEN IM BESICHERTEN SEGMENT.....	28
4. KONZEPTIONELLE DEFINITIONEN FÜR DAS UNBESICHERTE MARKTSEGMENT	35
4.1 ERLÄUTERUNGEN ZU DEN MELDEPFLICHTIGEN INSTRUMENTEN IM UNBESICHERTEN SEGMENT	35
4.2 MELDUNG VON TAGESGELDERN UND SPARKONTEN.....	37
4.2.1 <i>Tagesgelder.....</i>	37
4.2.2 <i>Sparkonten.....</i>	37
4.3 PRIMÄRMARKT	39
4.4 ERLÄUTERUNGEN DER ZU MELDENDEN VARIABLEN IM UNBESICHERTEN SEGMENT	40
5. KONZEPTIONELLE DEFINITIONEN FÜR DAS SEGMENT DER DEVISENSWAP-GESCHÄFTE	
45	
5.1 MELDUNG VON DEVISENSWAPS	45

5.2	ERLÄUTERUNGEN DER ZU MELDENDEN VARIABLEN IM SEGMENT DER DEWESENSWAP-GESCHÄFTE.....	45
6.	KONZEPTIONELLE DEFINITIONEN FÜR DAS SEGMENT DER OVERNIGHT INDEX SWAPS	49
6.1	MELDUNG VON OVERNIGHT INDEX SWAPS	49
6.2	ERLÄUTERUNGEN DER ZU MELDENDEN VARIABLEN IM SEGMENT DER OVERNIGHT INDEX SWAPS.....	49
ANHANG 1:	CODELISTEN	52
ANHANG 2:	PLAUSIBILITÄTSPRÜFUNGEN	55
ANHANG 3:	LISTE DER ISINS MÖGLICHER REFERENZZINSSÄTZE	57
ANHANG 4:	LISTE SUPRANATIONALER ORGANISATIONEN	60
ANHANG 5:	LISTE DER MULTIPLIKATOREN ZUR BERECHNUNG DER FX FORWARD POINTS	62

1. Einleitung

Gegenstand der Geldmarktstatistik sind von inländischen Monetären Finanzinstituten (MFIs) mit Ausnahme von Geldmarktfonds durchgeführte, auf Euro lautende Transaktionen, die sie in den Segmenten unbesicherter und besicherter Geldmarkt sowie Devisen- und Overnight Index Swaps getätigt haben.¹

Zweck der Erhebung ist es umfassende, fundierte Informationen zu Geldmarktaktivität und -konditionen für das Eurosystem zu erfassen. Die relevanten Informationen müssen zeitnah und laufend zur Verfügung stehen, um sowohl eine Einschätzung der aktuellen Marktlage als auch die Erfassung struktureller Entwicklungen zu ermöglichen.

Meldepflichtig sind **einzelne Transaktionen**, die mit sämtlichen finanziellen Gegenparteien (ausgenommen sind Transaktionen mit Zentralbanken, die nicht zu Investitionszwecken getätigt werden), dem Staat oder nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften², die gemäß dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk als „Großkunden“³ gelten, durchgeführt wurden. Im Rahmen der unbesicherten Geldvergabe fallen nur Transaktionen mit anderen Kreditinstituten unter die Berichtspflicht. Es sind – mit Ausnahme von Transaktionen im Marktsegment der Overnight Index Swaps – nur solche Geschäfte zu erfassen, deren Laufzeit nicht über 397 Tage nach dem Abwicklungstag liegt. Im Marktsegment der Overnight Index Swaps sind Transaktionen aller Laufzeiten zu melden.

2. Allgemeine Anforderungen

2.1 Gegenstand der Erhebung und Begriffsbestimmungen

2.1.1 Geldmarktsegmente

Die folgenden vier Segmente sind durch die Geldmarkterhebung abgedeckt:

- (a) **Besicherte Geldmarkttransaktionen:** Als besicherte Geldmarkttransaktionen sind sämtliche auf Euro lautende Rückkaufsvereinbarungen und sämtliche der im Rahmen dieser Rückkaufsvereinbarungen abgeschlossenen Geschäfte zu melden, die eine Laufzeit bis einschließlich 397 Tage haben und mit einer der folgenden Gegenparteien abgeschlossen werden: sämtliche finanzielle Gegenparteien (ausgenommen sind Trans-

¹ Verordnung (EU) Nr. 1333/2014 vom 26. November 2014 über Geldmarktstatistiken (EZB/2014/48) verabschiedet (ABl. EU Nr. L 359 vom 16.12.2014, S. 97; „Geldmarktstatistikverordnung“), geändert durch Verordnung EZB/2015/30, Verordnung EZB/2018/33, Verordnung EZB/2019/29 und Verordnung EZB/2020/58.

² Begriffsbestimmungen siehe Artikel 1 der Verordnung (EU) Nr. 1333/2014 der Europäischen Zentralbank vom 26. November 2014 über Geldmarktstatistiken (EZB/2014/48). Erläuterungen zur Sektorengliederung gemäß ESVG 2010 siehe auch Statistische Sonderveröffentlichung 2, Kundensystematik, Seite 11 ff.

³ „Großkunde“ („Wholesale“) wird in Artikel 86 bzw. 90/91 des Basel-III-LCR-Rahmenwerk definiert. Das Basel-III-LCR-Rahmenwerk ist unter folgendem Link einsehbar: https://www.bis.org/publ/bcbs238_de.pdf.

aktionen mit Zentralbanken, die im Rahmen geldpolitischer Operationen des Eurosystems über ein Tenderverfahren bzw. ständige Fazilitäten durchgeführt werden), Staat, nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften, die als „Großkunden“ nach dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk klassifiziert sind. Außerdem fallen Wertpapierleihe-gegen-Cash-Geschäfte unter die Meldepflicht.

- (b) **Unbesicherte Geldmarkttransaktionen:** In der unbesicherten Geldaufnahme sind alle auf Euro lautenden Transaktionen mit sämtlichen finanziellen Gegenparteien (ausgenommen sind Transaktionen mit Zentralbanken, die nicht zu Investitionszwecken getätigt werden), dem Staat und nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, die als „Großkunden“ nach dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk klassifiziert sind, zu melden, die eine Laufzeit bis einschließlich 397 Tage haben.

In der unbesicherten Geldvergabe sind alle auf Euro lautenden Transaktionen mit Kreditinstituten zu melden, die eine Laufzeit bis einschließlich 397 Tage haben.

- (c) Ein **Devisenswapgeschäft** (Foreign Exchange Swap — FX Swap) bezeichnet ein Tauschgeschäft, bei dem ein Beteiligter dem anderen Beteiligten einen bestimmten Währungsbetrag veräußert und als Gegenleistung die Zahlung eines vereinbarten Betrags einer anderen Währung auf Grundlage eines vereinbarten Devisenkurses (der Devisenkassakurs) erhält und sich zugleich dazu verpflichtet, die verkaufte Währung zu einem zukünftigen Termin (dem Fälligkeitstag) gegen Verkauf der zunächst erworbenen Währung zu einem anderen Devisenkurs (dem Devisenterminkurs) zurückzukaufen.

Für die Geldmarktstatistik sind diese Geschäfte meldepflichtig, sofern eine der Währungen Euro ist, sie eine Laufzeit bis einschließlich 397 Tage nach dem Abwicklungstag haben und mit einer der folgenden Gegenparteien abgeschlossen werden: sämtliche finanzielle Gegenparteien (ausgenommen sind Transaktionen mit Zentralbanken, die im Rahmen geldpolitischer Operationen des Eurosystems über ein Tenderverfahren bzw. ständige Fazilitäten durchgeführt werden), Staat, nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften, die als „Großkunden“ nach dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk klassifiziert sind.

- (d) EURO-Overnight Index Swaps — OIS bezeichnen einen auf Euro lautenden Zinsswap, dessen periodisch variabler Zinssatz dem geometrischen Mittel eines Tagesgeldsatzes (oder eines Tagesgeldreferenzsatzes) über einen bestimmten Zeitraum entspricht. Die endgültige Zahlung wird als Differenz zwischen dem vereinbarten festen Zinssatz und dem Effektivzinssatz der einzelnen Fixings auf den Nennwert des Geschäfts berechnet.

Für die Geldmarktstatistik sind diese Geschäfte **unabhängig von ihrer Laufzeit meldepflichtig**, sofern sie mit einer der folgenden Gegenparteien abgeschlossen werden: sämtliche finanzielle Gegenparteien (ausgenommen sind Transaktionen mit Zentral-

banken, die nicht zu Investitionszwecken getätigt werden), Staat, nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften, die als „Großkunden“ nach dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk klassifiziert sind.

2.1.2 Umfang der Berichterstattung

Gemäß der Geldmarktstatistikverordnung Art. 3 Nr. 1 besteht die Meldepflicht eines Instituts für das berichtspflichtige Institut „auf konsolidierter Basis, einschließlich der Daten für sämtliche ihrer Zweigniederlassungen in der Union und den EFTA-Staaten⁴ sowie ihrer Zweigniederlassungen im Vereinigten Königreich...“. Hierbei bezieht sich die Bezeichnung „Zweigniederlassung“ gemäß Art. 1 Nr. 16 und 17 der Verordnung auf eine „Betriebsstelle, die einen rechtlich unselbstständigen Teil eines Instituts bildet und unmittelbar sämtliche Geschäfte oder einen Teil der Geschäfte betreibt, die mit der Tätigkeit des Instituts verbunden sind“ (Nr. 16) bzw. auf eine „Zweigniederlassung, die sich in einem Mitgliedstaat der Union, in einem EFTA-Staat oder dem Vereinigten Königreich befindet und dort registriert ist“ (Nr. 17). Dies bedeutet, dass die Konzernmutter eine Meldung einschließlich der Geschäfte ihrer (rechtlich unselbstständigen) Zweigniederlassungen in der EU, EFTA und dem Vereinigten Königreich zu erstellen hat, jedoch für rechtlich selbstständige Institute innerhalb des Konzerns keine Meldung abzugeben ist (falls diese keinen gesonderten Meldebescheid erhalten haben). Gruppeninterne Transaktionen unterliegen keiner Meldepflicht. Als gruppenintern gelten Transaktionen, die mit Instituten und Unternehmen, die dem erweiterten Konsolidierungskreis angehören, abgeschlossen werden.

Für eine Meldung in der Geldmarktstatistik ist es von Bedeutung, wo eine Transaktion gebucht wird und nicht, wo die Transaktion veranlasst bzw. ausgeführt wird. Dies soll im folgenden Beispiel eines **deutschen Instituts** verdeutlicht werden⁵:

Veranlassung der Transaktion (in Euro)	Buchung der Transaktion	Meldepflicht des deutschen Instituts?
Filiale in Hong-Kong	Hong-Kong	Nein
Filiale in Hong-Kong	Frankfurt	Ja
Filiale in Frankfurt	Frankfurt	Ja
Filiale in Paris	Stockholm	Ja
Filiale in Frankfurt	New York	Nein
Filiale in Stockholm	Stockholm	Ja

⁴ Zu den EFTA-Staaten gehören Island, Liechtenstein, Norwegen und die Schweiz.

⁵ Die Beispiele beziehen sich auf aktuelle EU- und EFTA-Staaten sowie das Vereinigte Königreich und können Änderungen unterliegen.

Veranlassung der Transaktion (in Euro)	Buchung der Transaktion	Meldepflicht des deutschen Instituts?
Filiale in Stockholm	Paris	Ja
Filiale in New York	New York	Nein
Filiale in New York	Paris	Ja
Filiale in London	Frankfurt	Ja
Filiale in London	London	Ja
Filiale in London	New York	Nein

2.1.3 Definition von Geschäften mit nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften

Im Rahmen der Meldung zur Geldmarktstatistik müssen unter anderem Transaktionen mit nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften gemeldet werden, die als „Wholesale“ im Sinne des Basel III Rahmenwerks gelten.

2.2 Erläuterungen zur Datenübertragung

2.2.1 Einreichungsfrist und Richtigkeit der Daten

Die Meldung zur Geldmarktstatistik ist täglich **bis spätestens 6:30 Uhr am nächsten TARGET2-Handelstag** abzugeben. Keine Meldepflicht besteht entsprechend samstags und sonntags sowie an TARGET2-Feiertagen. TARGET2-Feiertage sind Neujahr, Karfreitag, Ostermontag, 1. Mai sowie 25. und 26. Dezember.

Bei der Überprüfung der Datenqualität in Bezug auf die Veröffentlichung der Euro Short-Term Rate müssen die berichtspflichtigen Institute sicherstellen, dass gemäß dem Anhang IV (2) der Geldmarktstatistikverordnung eine unverzügliche Rückmeldung auf Rückfragen zur Bestätigung der Richtigkeit der Daten gewährleistet ist.

2.2.2 Datenübertragung

Im Rahmen der Geldmarktstatistik besteht eine Meldepflicht für die vier Marktsegmente besicherter Geldmarkt, unbesicherter Geldmarkt sowie Devisen- und Overnight Index Swaps. Dabei ist jede Transaktion einzeln nach dem „transaction-by-transaction“-Prinzip zu melden.

Die Mindestanforderungen gemäß dem Anhang IV (2) und (4) der Geldmarktstatistikverordnung erfordern die Bereitstellung von Informationen zu den Entwicklungen in den gemeldeten Daten sowie entsprechende Korrekturen, sofern fehlerhafte Meldungen festgestellt werden. In

diesem Zusammenfang sollten die Berichtspflichtigen die gemeldeten Transaktionsdaten und -dateien mindestens fünf Jahre lang aufbewahren.

Die Meldung wird über das ExtraNet an die Deutschen Bundesbank übertragen. Für jedes Marktsegment ist eine XML-Datei einzureichen. Sollten an einem Handelstag in einem Marktsegment keine meldepflichtigen Transaktionen durchgeführt werden, ist eine Fehlanzeige dafür abzugeben. Pro Tag sind demzufolge pro Institut vier Dateien an die Deutsche Bundesbank zu übermitteln.

Es ist täglich pro Marktsegment eine einzige Meldung einzureichen. Eine wiederholte Einreichung für denselben Referenztag ist lediglich bei technischen Fehlern (Report Status „INCF“ oder „CRPT“) möglich. Korrekturen und fehlende Transaktionen sind generell in die Meldung des darauffolgenden TARGET2-Handelstages aufzunehmen. Wiederholte Nichtmeldungen oder systematisches „Over-Reporting“ oder „Under-Reporting“ können zu einer Sanktionierung führen.

Bewährte Methoden von Meldepflichtigen, die dazu beitragen, potenzielle Übertragungsprobleme zu minimieren:

- Geeignete interne Testverfahren und Prüfungen für die Wartung von IT-Systemen, die sich direkt oder indirekt auf den MMSR-Datenversand auswirken (bspw. Handelssysteme, Meldesysteme)
- Vorverlegung der MMSR-Übertragung (bspw. Meldung am Vorabend)
- Personalverfügbarkeit früh morgens an Target-2-Geschäftstagen, um potenzielle technische Probleme zu lösen und/oder die MMSR-Dateien manuell im ExtraNet der Deutschen Bundesbank hochzuladen
- Implementierung eines automatisierten Wiederholungsprozesses (Retry-Prozess) für den Fall, dass die ursprüngliche Einreichung fehlschlägt
- Ausreichende Überprüfung auf Testumgebung, regelmäßiges Üben der manuellen Einreichung von Daten, Einrichtung und Verwendung eines Notfallweges im Falle von Übertragungsproblemen

Erstmalig abgeschlossene (neue) Transaktionen sind im Feld „Reported Transaction Status“ (Transaktionsstatus) mit dem Flag „NEWT“ zu kennzeichnen. Sofern nach der erstmaligen Erfassung Korrekturbedarf festgestellt wird, ist eine Korrekturmeldung abzugeben. Hierbei besteht eine Unterscheidung zwischen „Amendment“ („AMND“) und „Correction“ („CORR“). Ein „Amendment“ bezeichnet einen Meldefehler, der seitens des Instituts aufgefallen ist. „Correction“ ist im Gegenzug anzugeben, wenn eine Korrektur aufgrund einer Rückmeldung der Deutschen Bundesbank durchgeführt wird. Die Kennzeichnung „Cancellation“ („CANC“) dient der

Kennzeichnung von Transaktionen, die gelöscht werden müssen, da sie beispielsweise doppelt gemeldet wurden.

2.2.3 Unique Transaction Identifier

Sofern zum Zeitpunkt der Meldungseinreichung verfügbar, ist die Meldung eines Unique Transaction Identifier⁶ (UTI) erforderlich. Dieser sollte grundsätzlich für Transaktionen in den Segmenten besicherter Geldmarkt, FX-Swaps sowie OIS verfügbar sein.

Falls die UTI erst nach Einreichung der Meldung verfügbar ist (bspw. am Folgetag), besteht keine Notwendigkeit, eine Korrektur für die entsprechende Transaktion mit der ergänzten UTI einzureichen.

Für Open Repos und ähnliche Transaktionen, die täglich als NEWT gemeldet werden, ist für die initiale Meldung und die folgenden Rollover die gleiche UTI zu verwenden.

Es ist stets die vollständige UTI ohne Kürzung eines Teils der UTI zu melden, also die Kombination aus UTI-Prefix und UTI-Value. Bei FX-Swaps ist grundsätzlich nur ein UTI zu melden. Sollten für die kurze Seite (Near Leg) und lange Seite (Far Leg) des FX-Swaps unterschiedliche UTIs vorliegen, ist die UTI der langen Seite (Far Leg) zu melden.

Die Meldung der UTI - sofern bei Meldungseinreichung verfügbar - ist für Geschäfte ab dem Referenztag 31.03.2022 verpflichtend.

2.2.4 Korrekturen

Die gemeldeten Transaktionen müssen die vom Berichtspflichtigen vereinbarten Geschäftskonditionen korrekt widerspiegeln. Sollte dies nicht der Fall sein, ist eine Korrektur vorzunehmen. Dabei muss die Korrektur den identischen Proprietary Transaction Identifier (PTI) aufweisen wie die ursprünglich eingereichte Transaktion.

Korrekturen müssen innerhalb von zehn TARGET2-Handelstagen nach der erstmaligen Meldung erfolgen. Wenn der Berichtspflichtige Korrekturen nach dieser Frist durchzuführen hat, muss die Bundesbank (i) über die Nichteinhaltung dieser Frist informiert und (ii) über die Gründe der Nichteinhaltung der Frist sowie den Zeitpunkt der Korrekturmeldung in Kenntnis gesetzt werden.

Korrekturen, die im Rahmen von strukturellen Meldeproblemen notwendig werden, müssen rückwirkend mindestens bis zum Beginn des vorherigen Kalenderjahres, gerechnet ab dem Zeitpunkt der Identifizierung des Meldeproblems, erfolgen. Zum Beispiel, für den Fall, dass ein Meldeproblem am 30. September 2021 identifiziert wird, müssen Korrekturen mindestens rückwirkend bis zum 1. Januar 2020 eingereicht werden. Der Zeitraum bleibt unverändert unabhängig davon, ob das Meldeproblem am 2. Dezember 2021 oder am 3. März 2022 gelöst wird.

⁶ Das UTI-Schema ist in ISO 23897:2020 definiert.

Ungeachtet des Mindestzeitraums für die Korrekturen erfolgen müssen, sind die Berichtspflichtigen ermutigt Korrekturen für den gesamten Zeitraum bis zum ersten Tag deren Meldungseinreichung einzureichen.

Für Berichtspflichtige, welche nach dem 1. Januar 2021 zur Abgabe von Geldmarktstatistiken verpflichtet wurden (im Folgenden als „neue Berichtspflichtige“ bezeichnet), gilt die oben genannte Regelung nicht innerhalb der ersten drei Meldejahre.⁷ Neue Berichtspflichtige müssen bis zum Ende des dritten Kalenderjahres ihrer Meldung Korrekturen rückwirkend bis zum Tag ihrer ersten Meldungseinreichung vornehmen. Zum Beispiel, muss ein neuer Berichtspflichtiger, welcher zum 1. Juli 2021 meldepflichtig geworden ist, Korrekturen vom 1. Juli 2021 bis 31. Dezember 2023 einreichen. Im Anschluss an das Ende des dritten Kalenderjahres gilt der grundsätzliche Mindestzeitraum für Korrekturen rückwirkend bis zum Beginn des vorherigen Kalenderjahres.

Korrekturen sind generell in die reguläre Meldung des darauffolgenden Tages zu integrieren und wie folgt zu klassifizieren:

- „Amendments“ („AMND“) sind Korrekturen, die ohne den Hinweis durch das Eurosystem vom Berichtspflichtigen durchgeführt werden.
- „Corrections“ („CORR“) sind Korrekturen, die aufgrund von Hinweisen durch das Eurosystem durchzuführen sind.
- „Cancellations“ („CANC“) sind Stornierungen bereits gemeldeter Transaktionen.

Folgende Variablen sind im Fall von Änderungen bereits gemeldeter Transaktionen anzugeben:

- Reported Transaction Status (Transaktionsstatus)
- PTI (interne Transaktionskennung)
- Alle weiteren Felder, unabhängig davon, ob sie sich verändert haben oder nicht. Allerdings müssen bei Cancellations nur Fehler im xsd-Schema korrigiert werden. Eine Transaktion wird gelöscht, wenn sie den Data Quality Check DQX104 erfolgreich durchläuft. Weitere Data Quality Checks werden bei Cancellations nicht durchgeführt.

Nach der Einführung des UTI wird dieser anstelle der PTI genutzt, um Korrekturen und Stornierungen von Transaktionen durchzuführen.

⁷ Die Regelung für neue Berichtspflichtige gilt nur, sofern der neue Berichtspflichtige nicht aufgrund von Corporate Events (wie bspw. Fusionen) aktuell Berichtspflichtige entstanden ist. Hier gilt der grundsätzliche Mindestzeitraum für Korrekturen rückwirkend bis zum Beginn des vorherigen Kalenderjahres.

2.2.5 Neuverhandlungen

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

Werden die Konditionen einer gemeldeten Transaktion nach der ursprünglichen Vereinbarung neuverhandelt (zum Beispiel Neuverhandlung des Zinssatzes oder der Laufzeit des Geschäfts), erfolgt eine (neue) Meldung dieser Transaktion als neues Geschäft („NEWT“) mit den neuen Konditionen und einer neuen Transaktionskennung. Bei Neuverhandlungen werden bereits vereinbarte Konditionen geändert. Eine Cancellation der alten Transaktion soll nicht erfolgen. Die neuverhandelte Transaktion wird mit dem Novation Status „NONO“ (sofern es sich bei der Neuverhandlung nicht zusätzlich um eine Novation handelt) und ohne eine zugehörige interne Transaktionskennung (Related PTI) gemeldet.

Für Transaktionen mit einer festen Laufzeit sind Life-Cycle-Events wie beispielsweise Tilgungen, automatische Zinsanpassungen, Margin Calls, ein Austausch von Sicherheiten, Rückkäufe von Wertpapieren sowie Compression Trades und Novations von Compression Trades ebenso wie die Aufnahme von und/oder Wechsel zu vorher festgelegten Fallback-Referenzzinssätzen bzw. gesetzlich oder durch Clearingstellen/CCPs auferlegter Änderungen des vorgeschriebenen Referenzzinssatzes generell von einer Meldepflicht ausgenommen. Ein Life-Cycle-Event ist ein Ereignis, dessen möglicher Eintritt bereits bei Vertragsabschluss berücksichtigt oder einem oder beiden Vertragsparteien auferlegt wurde und keine Neuverhandlung beinhaltet. Außerdem gelten Änderungen des Fallback Referenzzinssatzes ebenfalls nicht als Neuverhandlung. Für Transaktionen, die auf täglicher Basis gemeldet werden müssen (bspw. Evergreens oder Transaktionen ohne feste Laufzeit), gilt die oben beschriebene Regelung bezüglich der Nichtmeldung von Life-Cycle-Events nicht. Demnach müssen Änderungen jeder Variable der Transaktion in dem neu gemeldeten Rollover berücksichtigt werden, unabhängig aus welchem Grund sich diese ergab.

2.2.6 Novations

Novations sind als neue Transaktion („NEWT“) mit den neu verhandelten Geschäftskonstellationen und -konditionen sowie einer neuen Transaktionskennung zu melden.

Folgende Besonderheiten sind bei der Meldung von Novations zu beachten:

- a) Handelstag und Novation fallen auf einen Tag:

Der Berichtspflichtige meldet nur die Novation als neue Transaktion mit den neu verhandelten Konditionen. Die Meldung der Variable „Novation Status“ mit dem Flag „NOVA“ ist obligatorisch, sofern es sich um eine Novation handelt. Wir empfehlen die Angabe des Novation Status auch für alle anderen Transaktionen mit dem Flag „NONO“. Die Variable „Zugehörige interne Transaktionskennung“ ist nicht zu melden.

b) Handelstag und Novation fallen mindestens einen Tag auseinander:

Die Novation wird als neue Transaktion mit dem Novation Status „NOVA“ gemeldet. Des Weiteren ist die PTI der zugehörigen, geänderten Transaktion im Feld „Zugehörige interne Transaktionskennung“ zu melden, wenn diese Transaktion zuvor meldepflichtig war.

Zusätzlich sind folgende Regeln zu beachten:

- Die verbleibende Gegenpartei meldet eine neue Transaktion, die den neu eingestiegenen Kontrahenten als Gegenpartei ausweist. In Bezug auf die Meldung des Novation Status und der zugehörigen internen Transaktionskennung gelten die Regeln unter a) und b).
- Die neu eingestiegene Gegenpartei meldet eine neue Transaktion, die den verbleibenden Kontrahenten als Gegenpartei ausweist. Die Variable „Novation Status“ ist mit dem Flag „NOVA“ zu melden. Eine zugehörige PTI im Feld „Zugehörige interne Transaktionskennung“ ist nicht anzugeben.
- Die aussteigende Gegenpartei hat keine Meldung in Form einer Korrektur oder einer Cancellation abzugeben.

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

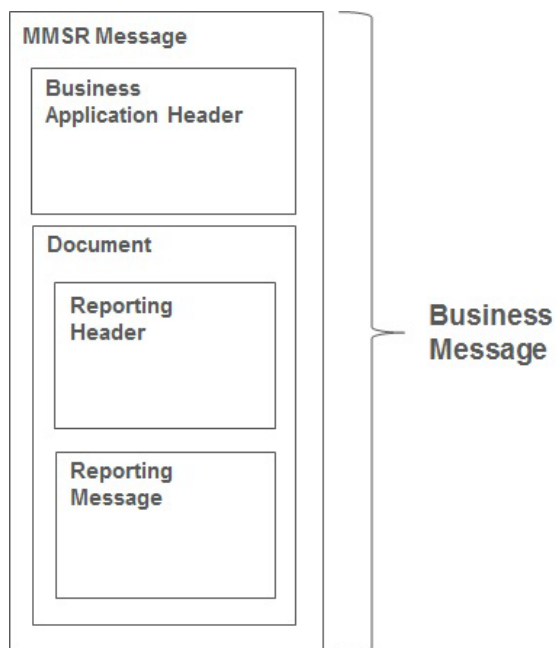
Eine Novation ist nur dann als neue Transaktion zu melden, wenn sie die Voraussetzungen einer Meldepflicht zur Geldmarktstatistik erfüllt (z.B. der neue Kontrahent stellt eine meldepflichtige Gegenpartei dar). Für den ursprünglichen Trade einer Novation ist in keinem Fall eine Cancellation einzureichen.

2.3 Konzeptionelle Rahmenstruktur

Jede Datei (Business Message), die eingereicht wird, besteht aus zwei Teilen:

- (a) Der **Business Application Header (BAH)** dient der Identifikation der Meldung und enthält Zustellinformationen.
- (b) Der **Hauptteil (Document)** besteht aus zwei Teilen: dem Reporting Header und der Reporting Message für das betroffene Marktsegment.
 - (i) Der **Reporting Header** dient der Erkennung des Berichtspflichtigen, des Berichtszeitraums sowie des Inhalts der Meldung.
 - (ii) Die **Reporting Message** enthält alle relevanten Informationen zu der berichtspflichtigen Transaktion.

Diese Struktur wird im Folgenden grafisch dargestellt:



2.3.1 Konzeptionelle Struktur des Business Application Header

Die Variablen des Business Application Headers und entsprechende Erläuterungen sind in der folgenden Tabelle aufgeführt:

Variable	Erläuterung
Meldungs-ID (Business Message Identifier)	Die Meldungs-ID setzt sich aus einer Kennung für das berichtspflichtige Institut und einer einzigartigen sechsstelligen Zahl zusammen, um so jede einzelne Meldung individuell zuordnen zu können.
Sender	Diese Variable enthält den Legal Entity Identifier (LEI) des Absenders. Diese Variable ist als „From“ im BAH der MMSR message bezeichnet.
Empfänger (Receiver)	Diese Variable enthält den Legal Entity Identifier (LEI) der Deutschen Bundesbank. Diese Variable ist als „To“ im BAH der MMSR message bezeichnet.
Status (Business Service)	Diese Variable kennzeichnet den Status der eingereichten Meldung. Es gibt zwei gültige Ausprägungen: ECB_MMSR_PROD und ECB_MMSR_TEST. „ECB_MMSR_TEST“ soll ausschließlich verwendet werden, um den Übertragungsweg zu testen. Auf derart gekennzeichnete Meldungen werden keine Data Quality Checks angewandt. Sollen die eingereichten

Variable	Erläuterung
	Dateien inhaltlich geprüft und weiterverarbeitet werden, muss der Status „ECB_MMSR_PROD“ verwendet werden.
Marktsegment (Market Segment Identifier)	Mit dieser Variable wird spezifiziert, in welchem der folgenden Marktsegmente die Transaktion getätigt wurde: besicherter Geldmarkt, unbesicherter Geldmarkt, Devisenswaps oder Overnight Index Swaps. Diese Variable ist als „Message Definition Identifier“ im BAH der MMSR message bezeichnet.
Berichtstag (Creation Date)	Diese Variable bezeichnet das Erstelldatum der Meldung.

2.3.2 Konzeptionelle Struktur des Reporting Header

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

Variable	Erläuterung
Berichtspflichtiger (Reporting Agent)	Diese Variable enthält den LEI des berichtspflichtigen Instituts.
Meldetermin (Reference Period)	Diese Variable enthält den Berichtszeitraum der Transaktionen, die in der Meldung enthalten sind (Handelstag („trade date“) für neue Transaktionen und an diesem Tag durchgeführte Revisionen).

2.3.3 Konzeptionelle Definition einer Fehlanzeige

Sollte ein Berichtspflichtiger in einem Marktsegment keine Transaktionen getätigt haben, ist eine Fehlanzeige abzugeben:

Variable	Erläuterung
Fehlanzeige (Data Set Action)	Mit Meldung der Variable „NOTX“ bestätigt der Berichtspflichtige, dass am Berichtstag keine Transaktion im betreffenden Marktsegment getätigt wurde. <i>Dieses Feld ist optional. Im Falle der Meldung von Transaktionen ist es nicht in der XML-Datei enthalten.</i>

3. Konzeptionelle Definitionen für das besicherte Marktsegment

Durch berichtspflichtige Institute sind alle relevanten Transaktionen im besicherten Geldmarkt an die Deutsche Bundesbank zu melden. Hierzu zählen alle Repogeschäfte mit festen Laufzeiten sowie BAW-Repos (Open Repos) und Wertpapierleihen gegen Cash, einschließlich auf Euro lautende Tri-Party-Repos, jeweils mit einer Ursprungslaufzeit bis einschließlich 397 Tage nach dem Abwicklungstag. Meldepflichtig sind einzelne Transaktionen, die mit sämtlichen finanziellen Gegenparteien (ausgenommen sind Transaktionen mit Zentralbanken, die im Rahmen geldpolitischer Operationen des Eurosystems über ein Tendersverfahren bzw. ständige Fazilitäten durchgeführt werden), dem Staat und nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, die als „Großkunden“ nach dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk klassifiziert sind, durchgeführt werden.

Eine **Rückkaufsvereinbarung** (Repurchase Agreement, **Repo**) bezeichnet eine Vereinbarung, unter der die an der Vereinbarung beteiligten Parteien Geschäfte tätigen können, bei denen ein Beteiligter (Verkäufer) sich dazu verpflichtet, dem anderen Beteiligten (Käufer) an einem festgelegten Termin in naher Zukunft – gegen Zahlung des Kaufpreises durch den Käufer an den Verkäufer – bestimmte Vermögenswerte (Wertpapiere, Rohstoffe oder sonstige finanzielle Vermögenswerte) zu veräußern. Zugleich verpflichtet sich der Käufer dazu, dem Verkäufer die Vermögenswerte entweder an einem festgelegten Termin in der Zukunft oder auf Verlangen – gegen Zahlung des Rückkaufpreises durch den Verkäufer an den Käufer – wieder zu veräußern. Ein solches Geschäft kann jeweils als eine Rückkaufsvereinbarung bzw. als ein **Kauf- und Rückkaufgeschäft** bestehen. Eine Rückkaufsvereinbarung kann auch die Vereinbarung bezeichnen, Vermögenswerte unter Gewährung eines allgemeinen Rechts auf Wiederverwendung an einem Termin in naher Zukunft gegen die Gewährung eines Barkredits zu verpfänden, wobei der Kredit mitsamt Zinsen an einem späteren Termin in der Zukunft gegen Rückgewähr der Vermögenswerte zurückzuzahlen ist. Repogeschäfte können mit einer vorab festgelegten Laufzeit (Repogeschäfte mit fester Laufzeit) oder ohne eine solche vorab festgelegte Laufzeit getätigt werden; im letzteren Fall haben beide Beteiligten die Möglichkeit, die Vereinbarung jeden Tag zu verlängern oder zu beenden (Bis-auf-Weiteres (BAW)-Repogeschäfte).

Ein **Tri-Party-Repogeschäft** bezeichnet ein Repogeschäft, bei dem ein Dritter während der Laufzeit des Geschäfts die Auswahl und Verwaltung der Sicherheiten übernimmt. Auch diese Geschäfte unterliegen der Meldepflicht.

Folgende Hinweise gelten in Bezug auf Tri-Party-Repogeschäfte sowie Kauf- und Rückkaufgeschäfte:

- Für den Fall, dass Transaktionen mit mehreren Sicherheiten besichert sind, welche über eine ISIN identifiziert werden können (z.B. Sicherheitenpools der EUREX/ GC Pooling und LCH/GC+), müssen diese ISINs gemeldet werden. Eine Angabe über die Art der Sicherheit oder Informationen über die endgültige Zuordnung der Sicherheiten durch die CCP sind in diesem Fall nicht erforderlich.

- Sollte die Sicherheit nicht über eine oder mehrere ISINs identifiziert werden können, ist die Art der Sicherheit zu melden. Dies ist sowohl für bilateral abgeschlossene Repos, als auch über eine CCP geclearte und Tri-Party-Repos anzuwenden. Als Sicherheitenart ist der entsprechende Classification of Financial Instrument (CFI) Code zu verwenden. Zusätzlich ist die Information über den Poolstatus und der Sektor des Emittenten zu melden.
- Liegt ein Sicherheitenpool vor, der nicht über eine ISIN identifizierbar ist, ist der CFI Code der Sicherheit mit dem größten Anteil zu verwenden.
- Kauf- und Rückkaufgeschäfte sind im Rahmen der Geldmarktstatistik nur am Handelstag zu melden. Das Rückkaufgeschäft selbst unterliegt nicht der Meldepflicht.
- Für Tri-Party-Repogeschäfte gelten die gleichen Regeln wie oben beschrieben. Darüber hinaus muss das Feld zur Identifikation des Tri-Party Agents mit der entsprechenden LEI befüllt und gemeldet werden.

3.1 Meldung von Open Repos, Evergreens und Extendible Repos

3.1.1 Open Repos mit Overnight Maturity

Open Repos⁸ (open-basis repurchase agreements) sind Repos ohne feste Laufzeit und mit einer Kündigungsfrist, die nicht über die konventionelle oder obligatorische Abwicklungsfrist von Sicherheiten (i.d.R. T+0, T+1 oder T+2) hinausgeht. Open Repos sind durchgehend täglich als neue Transaktion mit der Transaktionskennung „NEWT“ und neuem PTI zu melden, wobei Handels-, Abwicklungs- und Fälligkeitstag rolliert werden müssen. Der Handelstag spiegelt dabei den Tag des Rollovers wider.

Ein Open Repo mit Overnight Laufzeit (Laufzeit = 1 Tag) muss folgende Struktur aufweisen:

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

Grundsätzlich ist für den Handels- sowie Abwicklungstag der Tag T zu melden. Sollte jedoch bei Geschäftsabschluss ein von T abweichender erster Abwicklungstag verhandelt worden sein (z.B. T+2), ist dieser in der ersten Meldung des Open Repos entsprechend auszuweisen. Für alle auf diesen Abwicklungstag folgenden Rollover ist die oben beschriebene Struktur einzuhalten (vgl. Beispiel 1). Die Meldung eines Open Repos erfolgt bis zur Rückzahlung bzw. Kündigung täglich, auch wenn der gesamte Zeitraum der Meldungen 397 Tage überschreitet. Das Closing eines Open Repos selbst unterliegt nicht der Meldepflicht zur Geldmarktstatistik. Änderungen der Geschäftskonditionen (z.B. Neuverhandlung des Zinssatzes) sind in die Meldung des Rollovers einzubeziehen zu welcher die Änderung wirksam wird. Ist die Verzinsung eines

⁸ Sofern nicht anders beschrieben, beziehen sich die Regelungen für die Meldung von Open Repos auch auf die Meldung von Open Evergreens.

Open Repos abhängig von der endgültigen Laufzeit des Geschäfts, ist der ursprünglich vereinbarte Zinssatz zu melden.

Zwei grundsätzliche Fälle können bei Kündigung eines Open Repos⁹ mit Overnight Maturity unterschieden werden. Wie die Meldung nach erfolgter Kündigung zu erfolgen hat, zeigen folgende Beispiele:

1. Das Open Repo wird zum nächstmöglichen Zeitpunkt gekündigt.

Beispiel 1: Das Open Repo wurde am Handelstag T abgeschlossen und an T+2 erstmalig abgewickelt. Es kann täglich mit einer Overnight Maturity gekündigt werden. An T+4 wird vereinbart, das Open Repo an T+5 zu schließen.

Tag	Handelstag	Abwicklungstag	Fälligkeits-tag	PTI	Kommentar
T	T	T+2	T+3	"A1"	Meldung eines neuen Open Repo
T+1					Keine Meldung
T+2					Keine Meldung
T+3	T+3	T+3	T+4	"A2"	Rollover
T+4	T+4	T+4	T+5	"A3"	Rollover
T+5					Geschäftsbeendigung: Keine Meldung

2. Das Open Repo wird vorzeitig zu einem bestimmten Tag, der vom nächstmöglichen Zeitpunkt abweicht, gekündigt.

Das Open Repo wird auch nach erfolgter Kündigung weiterhin jeden Tag als neue Transaktion (im Rahmen der üblichen Rollierungslogik) gemeldet, bis der gemeldete Fälligkeitstag dem vereinbarten Fälligkeitstag der Kündigung entspricht.

Beispiel 2a: Das Open Repo wurde am Tag T sowohl gehandelt als auch abgewickelt. Es kann täglich mit einer Overnight Maturity gekündigt werden. An T+4 wird vereinbart, das Open Repo an T+6 zu schließen.

Tag	Handelstag	Abwicklungstag	Fälligkeits-tag	PTI	Kommentar
T	T	T	T+1	"A1"	Meldung eines neuen Open Repo
T+1	T+1	T+1	T+2	"A2"	Rollover
T+2	T+2	T+2	T+3	"A3"	Rollover
T+3	T+3	T+3	T+4	"A4"	Rollover
T+4	T+4	T+4	T+5	"A5"	Rollover
T+5	T+5	T+5	T+6	"A6"	Letze Meldung
T+6					Geschäftsbeendigung: Keine Meldung

⁹ Kündigungen von Wertpapierleihen ohne feste Laufzeit mit Overnight Maturity werden analog gemeldet.

Sonderfall: Wird von beiden Vertragsparteien vereinbart, das Open Repo durch ein Repo mit fester Laufzeit zu ersetzen (Kündigung des Open Repos und Neuverhandlung eines Fixed Term Repos) erfolgt der Ausweis wie folgt: (a) Stoppen der täglichen Meldung des Open Repos und (b) Melden eines Repos mit fester Laufzeit als neue Transaktion.

Beispiel 2b: Das Open Repo wurde am Tag T gehandelt und abgewickelt und kann mit einer Overnight Maturity gekündigt werden. An T+4 wird vereinbart, das Open Repo per T+6 zu schließen. Hierfür wird von beiden Vertragsparteien vereinbart das Open Repo durch ein Fixed-Term Repo zu ersetzen. Somit liegt ab T+4 ein Repo mit fester Laufzeit vor.

Tag	Handelstag	Abwicklungstag	Fälligkeits-tag	PTI	Kommentar
T	T	T	T+1	“A1”	Meldung eines neuen Open Repo
T+1	T+1	T+1	T+2	“A2”	Rollover
T+2	T+2	T+2	T+3	“A3”	Rollover
T+3	T+3	T+3	T+4	“A4”	Rollover (letztmalige Meldung des Open Repos)
T+4	T+4	T+4	T+6	“B”	Meldung des Fixed Term Repos mit fester Laufzeit zum vereinbarten Laufzeitende. Die Meldung der Rollover wird mit dieser Meldung eingestellt.
T+5					Keine Meldung
T+6					Geschäftsbeendigung: Keine Meldung

3.1.2 Open Repos mit Kündigungsfrist (Open Evergreens)

Open Repos mit einer Kündigungsfrist, die über die gewöhnliche Abwicklungsfrist von Sicherheiten hinausgeht, werden als Open Evergreens¹⁰ bezeichnet.

Open Evergreens sind täglich als neue Transaktion mit der Transaktionskennung „NEWT“ und neuer PTI zu melden, wobei Handels-, Abwicklung- und Fälligkeitstag rolliert werden müssen. Der Handelstag spiegelt dabei den Tag des Rollovers wider. Die Meldung erfolgt analog zu Open Repos, jedoch mit der Ausnahme, dass als Fälligkeitstag der Tag anzugeben ist, an dem die Kündigungsfrist endet und somit der Kunde erstmalig über das Geld bzw. Wertpapier verfügen kann.

¹⁰ Weitere Details zu Best Practices und Standard-Konventionen zur Klassifizierung von Open Repos, Open Evergreens, Fixed-Term Evergreens und Extendible Repos werden von der International Capital Market Association (ICMA) bereitgestellt. Ein Open Repo ist definiert als ein Geschäft, das auf Verlangen von beiden Parteien kündbar ist und daher bis zur Kündigung weder ein Rückkaufdatum noch Rückkaufpreis besitzt. Standardmäßig beträgt die Kündigungsfrist eines Open Repos nicht mehr als die konventionelle oder obligatorische Abwicklungsfrist für Sicherheiten (i.d.R. T+0, T+1 oder T+2). Ein Open Evergreen Repo ist ein Geschäft ohne Rückkaufdatum, bei dem beide Parteien die Möglichkeit haben, das Geschäft mit einer Kündigungsfrist zu kündigen, die über die gewöhnliche Abwicklungsfrist für Sicherheiten hinausgeht. Siehe: [A Guide to best practice in the European Repo Market](#), ICMA, März 2021.

Wird das Geschäft gekündigt, erfolgt die Meldung des Geschäfts täglich als NEWT bis zum Ende der Kündigungsfrist weiter. Es ist zu beachten, dass die Ursprungslaufzeit weiter gemeldet werden soll und nicht auf die verbleibenden Tage der Kündigungsfrist zu verkürzen ist.

Ein Open Evergreen mit Kündigungsfrist muss folgende Struktur aufweisen:

- Handelstag: T
- Abwicklungstag: T
- Fälligkeitstag: T + Kündigungsfrist

Grundsätzlich ist für den Handels- sowie Abwicklungstag der Tag „T“ zu melden. Sollte jedoch beim Geschäftsabschluss ein von „T“ abweichender erster Abwicklungstag verhandelt worden sein (z.B. T+2), ist dieser in der ersten Meldung des Open Evergreens entsprechend auszuweisen. Für alle auf diesen Abwicklungstag folgenden Rollovers ist die oben beschriebene Struktur einzuhalten. Die Meldung eines Open Evergreens erfolgt bis zur Rückzahlung ~~bzw. Kündigung~~ täglich, auch wenn der gesamte Zeitraum der Meldungen 397 Tage überschreitet. Das Closing eines Open Evergreens selbst unterliegt nicht der Meldepflicht zur Geldmarktstatistik. Änderungen der Geschäftskonditionen (z.B. Neuverhandlung des Zinssatzes) sind in die Meldung des Rollovers einzubeziehen zu welcher die Änderung wirksam wird. Ist die Verzinsung eines Open Evergreen abhängig von der endgültigen Laufzeit des Geschäfts, ist der ursprünglich vereinbarte Zinssatz zu melden.

Zwei grundsätzliche Fälle können bei Kündigung eines Open Evergreens¹¹ mit einer Kündigungsfrist unterschieden werden. Wie die Meldung nach erfolgter Kündigung zu erfolgen hat, zeigen folgende Beispiele:

1. Das Open Evergreen wird zum nächstmöglichen Zeitpunkt gekündigt.

Beispiel 1: Das Open Evergreen wurde am Tag T sowohl gehandelt als auch abgewickelt. Es kann täglich mit einer Kündigungsfrist von 3 Tagen gekündigt werden. An T+3 wird das Open Evergreen mit Fälligkeit T+6 gekündigt. Die Meldung erfolgt bis zur Beendigung des Geschäfts weiter, wobei jeder Rollover weiterhin die volle Kündigungsfrist widerspiegelt.

Tag	Handelstag	Abwicklungstag	Fälligkeitstag	PTI	Kommentar
T	T	T	T+3	„A1“	Meldung eines neuen Open Evergreen
T+1	T+1	T+1	T+4	„A2“	Rollover
T+2	T+2	T+2	T+5	„A3“	Rollover
T+3	T+3	T+3	T+6	„A4“	Rollover. Kündigung des Evergreens und weiter rollierende Meldung mit gleichbleibender Kündigungsfrist bis zum Ende des Geschäfts.
T+4	T+4	T+4	T+7	„A5“	Rollover

¹¹ Kündigungen von Wertpapierleihen ohne feste Laufzeit mit Kündigungsfrist werden analog gemeldet.

Tag	Handels-tag	Abwicklungs-tag	Fälligkeits-tag	PTI	Kommentar
T+5	T+5	T+5	T+8	„A6“	Letztmaliger Rollover
T+6					Geschäftsbeendigung: Keine Meldung

2. Das Open Evergreen wird vorzeitig zu einem bestimmten Tag, der vom nächstmöglichen Zeitpunkt abweicht, gekündigt.

Das Open Evergreen wird auch nach erfolgter Kündigung weiterhin jeden Tag als neue Transaktion (im Rahmen der üblichen Rollierungslogik) bis zum Ende der Kündigungsfrist gemeldet. Die Laufzeit muss dabei weiterhin die vollständige Kündigungsfrist widerspiegeln.

Beispiel 2a: Das Open Evergreen wurde am Tag T sowohl gehandelt als auch abgewickelt. Es kann täglich mit einer Kündigungsfrist von 3 Tagen gekündigt werden. Der Kunde weiß an T+3, dass das Geld an T+8 benötigt wird und kündigt das Open Evergreen bereits an T+3 mit Fälligkeit T+8. Die Meldung erfolgt bis zur Beendigung des Geschäfts weiter, wobei jeder Rollover weiterhin die volle Kündigungsfrist widerspiegelt.

Tag	Handels-tag	Abwicklungs-tag	Fälligkeits-tag	PTI	Kommentar
T	T	T	T+3	“A1”	Meldung eines neuen Open Evergreen
T+1	T+1	T+1	T+4	“A2”	Rollover
T+2	T+2	T+2	T+5	“A3”	Rollover
T+3	T+3	T+3	T+6	“A4”	Rollover. Kündigung des Evergreens zu T+8 und weiter rollierende Meldung mit gleichbleibender Kündigungsfrist bis zum Ende des Geschäfts.
T+4	T+4	T+4	T+7	“A5”	Rollover
T+5	T+5	T+5	T+8	“A6”	Rollover
T+6	T+6	T+6	T+9	“A7”	Rollover
T+7	T+7	T+7	T+10	“A8”	Letztmaliger Rollover
T+8					Geschäftsbeendigung: Keine Meldung

Sonderfall: Wird von beiden Vertragsparteien vereinbart, das Open Evergreen durch ein Fixed-Term Repo mit fester Laufzeit zu ersetzen (Kündigung des Open Evergreens und Neuverhandlung eines Fixed-Term Repos) erfolgt der Ausweis wie folgt: (a) Stoppen der täglichen Meldung des Open Evergreens und (b) Melden eines Repos mit fester Laufzeit als neue Transaktion.

Beispiel 2b: Das Open Evergreen wurde am Tag T sowohl gehandelt als auch abgewickelt. Es kann täglich mit einer Kündigungsfrist von 3 Tagen gekündigt werden. An T+3 wird vereinbart,

das Open Evergreen per T+8 zu schließen. Hierfür wird von beiden Vertragsparteien vereinbart das Open Evergreen durch ein Fixed Term Repo zu ersetzen. Somit liegt ab T+3 ein Repo mit fester Laufzeit vor.

Tag	Handelstag	Abwicklungstag	Fälligkeits-tag	PTI	Kommentar
T	T	T	T+3	“A1”	Meldung eines neuen Open Evergreen
T+1	T+1	T+1	T+4	“A2”	Rollover
T+2	T+2	T+2	T+5	“A3”	Rollover (letztmalige Meldung des Open Evergreens)
T+3	T+3	T+3	T+8	“B”	Meldung des Fixed-Term Repos mit fester Laufzeit zum vereinbarten Laufzeitende. Die Meldung der Rollover wird mit dieser Meldung eingestellt.
T+4					Keine Meldung
T+5					Keine Meldung
T+6					Keine Meldung
T+7					Keine Meldung
T+8					Geschäftsbeendigung: Keine Meldung

3.1.3 Fixed-Term Evergreens

Fixed-Term Evergreens¹² sind fortlaufend täglich als neue Transaktion mit der Transaktionskennung „NEWT“ und neuer PTI zu melden, wobei Handels-, Abwicklungs- und Fälligkeitstag rolliert werden müssen. Der Handelstag spiegelt dabei den Tag des Rollovers wider.

Ein Fixed Term Evergreen muss folgende Struktur aufweisen:

- Handelstag: T
- Abwicklungstag: T
- Fälligkeitstag: T + Kündigungsfrist

Sowohl für den Handels- als auch für den Abwicklungstag ist der Tag „T“ zu melden. Sollte jedoch beim Geschäftsabschluss ein von „T“ abweichender erster Abwicklungstag verhandelt worden sein (z.B. T+2), ist dieser in der ersten Meldung entsprechend auszuweisen. Der Fälligkeitstag der ersten Meldung und in den Rollovers spiegelt den ersten Tag wider, an dem die Rückzahlung des Fixed-Term Evergreens erfolgen kann und nicht das fest vereinbarte Ende

¹² Ein Fixed-Term Evergreen ist ein Evergreen mit fester Laufzeit. Laut ICMA handelt es sich um eine Transaktion mit einem festen endgültigen Rückkaufdatum, bei der beide Parteien die Möglichkeit haben, die Transaktion unter Einhaltung einer Kündigungsfrist zu kündigen. Siehe <https://www.icmagroup.org/assets/documents/Regulatory/Repo/ERCC-Guide-to-Best-Practice-March-2021-300321.pdf>, ICMA, März 2021.

des Geschäfts. Nach dem Abwicklungstag sind Fixed-Term Evergreens täglich bis zu ihrer Rückzahlung zu melden.

Änderungen der Geschäftskonditionen (z.B. Neuverhandlung des Zinssatzes) sind in die Meldung des Rollovers einzubeziehen zu welcher die Änderung wirksam wird. Die Kündigung von Fixed-Term Evergreens erfolgt wie bei der Kündigung von Open Repos.

Einige Repos mit fester Laufzeit haben ein „gleitendes“ Kauf- und Rückkaufdatum. Diese sogenannten „Crawling“-Repos sind so aufgebaut, dass sich am Ende jedes Geschäftstages sowohl das Kauf- als auch das Rückkaufdatum automatisch um einen Geschäftstag verschieben bis eine endgültige Terminfestsetzung stattfindet. Solche Transaktionen werden genauso wie Fixed-Term Evergreens gemeldet. Demnach sind diese täglich als neue Transaktion „NEWT“ zu melden, wobei das Fälligkeitsdatum jeweils dem ersten Tag entspricht, an dem das Fixed-Term Evergreen gekündigt werden kann.

Beispiel 1: Meldung eines Fixed-Term Evergreens mit Handelstag T und Abwicklungstag T+2 mit einem festgelegten Enddatum in 180 Tagen und einer Kündigungsfrist von 35 Tagen für eine vorzeitige Beendigung des Geschäfts. An T+15 wird die vorzeitige Kündigung des Geschäfts bekanntgegeben, wodurch das Geschäft an T+50 beendet wird. Die Gegenparteien einigen sich nicht auf ein ersetzendes befristetes Geschäft. Daher wird das Geschäft bis zur tatsächlichen Beendigung weiterhin täglich gemeldet.

Tag	Handelstag	Abwicklungstag	Fälligkeitstag	PTI	Kommentar
T	T	T+2	T+37	„1“	Meldung eines neuen Fixed-Term Evergreens. Der gemeldete Fälligkeitstag spiegelt die Kündigungsfrist wider. Das festgelegte Ende des Geschäfts wird nicht gemeldet.
T+1					Keine Meldung
T+2					Keine Meldung
T+3	T+3	T+3	T+38	„2“	Rollover des Fixed-Term Evergreens.
...	Tägliche Rollover des Fixed-Term Evergreens. Sämtliche Änderungen der Transaktionsdetails werden in den Rollovern dargestellt. Der Fälligkeitstag spiegelt jeweils die vollständige Kündigungsfrist wider.
T+15	T+15	T+15	T+50	„14“	Rollover des Fixed-Term Evergreens. Das Geschäft wird gekündigt und bis zur tatsächlichen Fälligkeit täglich weitergemeldet.
...	Tägliche Rollover des Fixed-Term Evergreens. Sämtliche Änderungen der

Tag	Handelstag	Abwicklungstag	Fälligkeitstag	PTI	Kommentar
					Transaktionsdetails werden in den Rollovern dargestellt. Der Fälligkeitstag spiegelt jeweils die vollständige Kündigungsfrist wider.
T+49	T+49	T+49	T+84	„48“	Rollover des Fixed-Term Evergreens
T+50					Geschäftsbeendigung: Keine Meldung

Beispiel 2: Meldung eines Fixed-Term Evergreen mit Handelstag T und Abwicklungstag T+2 mit einem festgelegten Enddatum in 90 Tagen und einer Kündigungsfrist von 15 Tagen für eine vorzeitige Kündigung. Die vorzeitige Kündigung wird nicht ausgeübt und das Geschäft läuft am festgelegten Enddatum in 90 Tagen aus. Die Gegenparteien einigen sich nicht auf ein ersetzendes befristetes Geschäft. Daher wird das Geschäft bis zur tatsächlichen Beendigung weiterhin täglich gemeldet.

Tag	Handelstag	Abwicklungstag	Fälligkeitstag	PTI	Kommentar
T	T	T+2	T+17	„1“	Meldung eines Fixed-Term Evergreens. Der gemeldete Fälligkeitstag stellt die vereinbarte Kündigungsfrist dar; das festgelegte Enddatum wird nicht gemeldet.
T+1					Keine Meldung
T+2					Keine Meldung
T+3	T+3	T+3	T+18	„2“	Rollover des Fixed-Term Evergreens.
...	Tägliche Rollover des Fixed-Term Evergreens. Sämtliche Änderungen der Transaktionsdetails werden in den Rollovern dargestellt. Der Fälligkeitstag spiegelt jeweils die vollständige Kündigungsfrist wider.
T+75	T+75	T+75	T+90	„74“	Rollover des Fixed-Term Evergreens. Es wird keine vorzeitige Kündigung ausgeübt, sodass das Geschäft weiterhin täglich gemeldet wird, bis es tatsächlich ausläuft.
...	Tägliche Rollover des Fixed-Term Evergreens. Sämtliche Änderungen der Transaktionsdetails werden in den Rollovern dargestellt.

Tag	Handelstag	Abwicklungstag	Fälligkeitstag	PTI	Kommentar
					Der Fälligkeitstag spiegelt jeweils die vollständige Kündigungsfrist wider.
T+89	T+89	T+89	T+104	„88“	Rollover des Fixed-Term Evergreens
T+90					Geschäftsbeendigung: keine Meldung

3.1.4 Extendible Repos

Extendible Repo¹³ werden als Repos mit fester Laufzeit gemeldet, wobei das vereinbarte Rückkaufdatum als Fälligkeitsdatum angegeben wird. Wird das Repo verlängert, wird ein neues Repo mit fester Laufzeit gemeldet, welches die neuen Transaktionsdetails widerspiegelt. Korrekturen für die zuvor gemeldeten Transaktionen haben keine zu erfolgen. Repos (ohne oder mit fester Laufzeit) die nicht täglich, sondern nur an bestimmten vorab vereinbarten Tagen (z.B. erster Tag je Quartal) gekündigt werden können, werden als Repos mit fester Laufzeit gemeldet. Dabei entspricht der Fälligkeitstag dem ersten Tag, an dem die Rückzahlung erfolgen kann. Wird die Kündigungsoption nicht ausgeübt und das Repo verlängert, wird ein neues Repo mit fester Laufzeit und folgender Struktur gemeldet:

- Handelstag: Kündigungsdatum des dazugehörigen vorherigen Repo
- Abwicklungstag: Fälligkeitsdatum des dazugehörigen vorherigen Repo
- Fälligkeitstag: erster Tag, an dem das neue Geschäft beendet werden kann

Beispiel: Meldung eines Extendible Repos mit Handelstag T, Abwicklungstag T+2, einem festgelegten Rückkaufstag in 30 Tagen und der täglichen Möglichkeit, das Geschäft um weitere 30 Tage zu verlängern. An T+20 wird das Repo mit sofortiger Wirkung um weitere 30 Tage verlängert. Es findet keine weitere Verlängerung statt.

Tag	Handelstag	Abwicklungstag	Fälligkeitstag	PTI	Kommentar
T	T	T+2	T+32	„1“	Meldung eines neuen Extendible Repo. Der gemeldete Fälligkeitstag entspricht dem festgelegten Rückkaufsdatum. Das Kündigungsdatum bzw. die Kündigungsfrist wird nicht gemeldet.
T+1 ... T+19					Keine Meldung

¹³ Im Sinne der ICMA ist ein Extendible Repo ein befristetes Geschäft, bei dem eine Partei der anderen Partei die Option einräumt, den Rückkaufstermin um eine weitere vereinbarte Laufzeit nach hinten zu verschieben. Bei einigen verlängerbaren Verträgen besteht die Option darin, das Rückkaufdatum zu verschieben und einen neuen verlängerbaren Vertrag mit den gleichen Bedingungen zu vereinbaren.

Tag	Handelstag	Abwicklungstag	Fälligkeitstag	PTI	Kommentar
T+20	T+20	T+20	T+50	„2“	Sofortige Verlängerung des Repos. Es wird eine neue Transaktion gemeldet, bei der der Fälligkeitstag dem neu vereinbarten Rückkaufsdatum entspricht. Änderungen anderer Transaktionsdetails werden in dieser Meldung berücksichtigt.
T+21 ... T+49					Keine Meldung
T+50					Geschäftsbeendigung: keine Meldung

3.2 Meldung von Wertpapierleihgeschäften gegen Cash

Wertpapierleihgeschäfte, bei denen Wertpapiere gegen Cash getauscht werden und bei denen „Delivery versus Payment“ (DVP) vereinbart worden ist, sind in die Meldung einzubeziehen.

Der Nennwert der Transaktion ist der Betrag, der aufgenommen bzw. entliehen wurde. Als Nennwert der Sicherheit ist der Nominalbetrag der verwendeten Sicherheit auszuweisen.

Im Fall von stücknotierten Papieren wird für die Berechnung des Sicherheitennennwerts die Anzahl der Stücke mit dem Preis pro Stück multipliziert.

Wertpapierleihgeschäfte, bei denen Wertpapier gegen Wertpapier getauscht wird, sind hingegen nicht berichtspflichtig. Wird Cash lediglich als Ausgleich der Marktwerte zweier Wertpapiere getauscht, unterliegt dies ebenfalls nicht der Meldepflicht.

Sollte es zu einer Transaktion kommen, bei der Wertpapiere gegen einen Wertpapierpool getauscht werden, ist dieses Geschäft meldepflichtig, wenn der Cash-Anteil im Wertpapierpool den größten Anteil ausmacht. Liegt ein Wertpapierpool vor, der aus mehreren Sicherheiten besteht, ist die Transaktion lediglich einmal mit einer PTI zu melden.

Wertpapierleihgeschäfte können z.B. klassische Eigenkapitalfinanzierungen (Equity Lending) sowie Exchange Traded Fund (ETF) Transaktionen und Kredite gegen die Stellung von Wertpapieren als Sicherheit (Securities Finance Loan – SFL) sein. Veränderungen der gestellten Sicherheiten werden als Life-Cycle-Events betrachtet und unterliegen nicht der Meldepflicht.

3.2.1 Wertpapierleihe ohne feste Laufzeit mit Overnight Maturity

Wertpapierleihgeschäfte ohne feste Laufzeit mit Overnight Maturity sind fortlaufend täglich als neue Transaktion mit der Transaktionskennung „NEWT“ und neuer PTI zu melden, wobei Handels-, Abwicklungs- und Fälligkeitstag rolliert werden müssen. Handelstag und Abwicklungstag spiegeln dabei den Tag des Rollovers wider. Die Meldung einer Wertpapierleihe ohne feste Laufzeit mit Overnight Maturity muss folgende Struktur aufweisen.

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

Sowohl für den Handels- als auch für den Abwicklungstag ist der Tag „T“ zu melden. Sollte jedoch beim Geschäftsabschluss ein von „T“ abweichender erster Abwicklungstag verhandelt worden sein (z.B. T+2), ist dieser in der ersten Meldung entsprechend auszuweisen. Sollte sich eine Änderung der Transaktionsdetails ergeben, ist diese in die Meldung des Rollovers einzubeziehen zu welcher die Änderung wirksam wird. Änderungen der Barsicherheiten auf Transaktionsebene in einer offenen Wertpapierleihe werden als Aktualisierung des Transaktionsnennwertes gemeldet.

3.2.2 Wertpapierleihe ohne feste Laufzeit mit Kündigungsfrist

Wertpapierleihgeschäfte ohne feste Laufzeit mit einer Kündigungsfrist, die über die gewöhnliche Abwicklungsfrist von Sicherheiten hinausgeht werden genauso gemeldet wie Wertpapierleihen ohne feste Laufzeit ohne Kündigungsfrist, mit der Ausnahme, dass der Fälligkeitstag dem Tag entspricht, an dem das Geschäft frühestens beendet werden kann. Gekündigte Wertpapierleihen werden analog zu gekündigten Open Repos gemeldet. Für Rollover von verlängerbaren Wertpapierleihegeschäften und Rollover von Wertpapierleihegeschäften mit oder ohne fester Laufzeit, die nicht täglich, sondern nur an vorab vereinbarten Tagen (z.B. erster Tag im Quartal) gekündigt werden können, gelten die entsprechenden Regelungen für die Meldung von Extendible Repos.

Beispiel: Meldung einer Wertpapierleihe ohne feste Laufzeit mit 5 Tagen Kündigungsfrist, Handelstag T und Abwicklungstag T+2. An T+4 einigen sich beide Gegenparteien auf eine Teilrückzahlung. An T+6 wird die Barsicherheit auf Transaktionsebene angepasst. An T+8 wird vereinbart, das Geschäft an T+13 zu schließen.

Tag	Handelstag	Abwicklungstag	Fälligkeitstag	PTI	Kommentar
T	T	T+2	T+7	„1“	Meldung einer Wertpapierleihe mit Abwicklungstag T+2 und einer Kündigungsfrist von 5 Tagen. <u>Transaktionsdetails</u> Transaktionsnennwert: 1 Mio. € (entsprechend Barsicherheit) Sicherheitenennwert: 0,95 Mio. € (entsprechend geliehener/verliehener Sicherheit) Haircut: -5,26316 (entsprechend Haircut-Formel)
T+1					Keine Meldung

Tag	Handelstag	Abwicklungstag	Fälligkeitstag	PTI	Kommentar
T+2					Keine Meldung
T+3	T+3	T+3	T+8	„2“	Rollover der Wertpapierleihe. Sofern keine Änderung der Transaktionsdetails: gleiche Daten wie in PTI „1“
T+4	T+4	T+4	T+9	„3“	Teilrückzahlung von 20% der Barsicherheiten. <u>Neue Transaktionsdetails</u> Transaktionsnennwert: € 0,8 Mio. Sicherheitenennwert: € 0,76 Mio. Haircut: -5,26316
T+5	T+5	T+5	T+10	„4“	Rollover der Wertpapierleihe. Sofern keine Änderung der Transaktionsdetails: gleiche Daten wie in PTI „3“
T+6	T+6	T+6	T+11	„5“	Nach einer Wertsteigerung der hinterlegten Sicherheiten werden die Barsicherheiten auf Handelsebene um 10% erhöht. <u>Neue Transaktionsdetails</u> Transaktionsnennwert: € 0,88 Mio. Sicherheitenennwert: € 0,836 Mio. Haircut: -5,26316
T+7	T+7	T+7	T+12	„6“	Rollover der Wertpapierleihe. Sofern keine Änderung der Transaktionsdetails: gleiche Daten wie in PTI „5“
T+8	T+8	T+8	T+13	„7“	Rollover der Wertpapierleihe. Die Kontrahenten einigen sich darauf, das Geschäft zu beenden, sodass es an T+13 endet.
T+9	T+9	T+9	T+14	„8“	Tägliches Rollover der Wertpapierleihe bis das Geschäft tatsächlich ausläuft.
T+10	T+10	T+10	T+15	„9“	Rollover
T+11	T+11	T+11	T+16	„10“	Rollover
T+12	T+12	T+12	T+17	„11“	Rollover
T+13					Geschäftsbeendigung: keine Meldung.

3.3 Erläuterungen der zu meldenden Variablen im besicherten Segment

Die zu meldenden Variablen und entsprechende Erläuterungen sind in folgender Tabelle aufgeführt:

Variable	Beschreibung
Transaktionsstatus (Reported Transaction Status)	Diese Variable enthält Informationen über den Status der Transaktion, d. h. ob es sich um eine neue Transaktion (new transaction, „NEWT“), eine Korrektur (amendment, „AMND“ oder correction, „CORR“) oder eine Transaktionslöschung (cancellation, „CANC“) handelt.
Novation Status (Novation Status)	Diese Variable spezifiziert, ob es sich bei der Transaktion um eine Novation handelt oder nicht. <i>Liegt eine Novation vor, ist dieses Feld ein Pflichtfeld. Die Angabe des Novation Status wird auch für alle anderen Transaktionen empfohlen.</i>
Transaktionskennung (Unique Transaction Identifier; UTI)	Diese Variable enthält den UTI, bei dem es sich um eine eindeutige Identifikationskennung einer Transaktion handelt. Zu melden, wenn UTI zum Zeitpunkt der Meldungseinreichung verfügbar ist.
Interne Transaktionskennung (Proprietary Transaction Identification; PTI)	Der PTI ist eine eindeutige interne Transaktionskennung des Berichtspflichtigen, welche für jede Transaktion zu melden ist und pro Berichtspflichtigen sowie pro Marktsegment einmalig sein muss.
Zugehörige interne Transaktionskennung (Related Proprietary Transaction Identification)	Die zugehörige interne Transaktionskennung ist die PTI der ursprünglichen Transaktion, die durch eine Novation ersetzt wurde. <i>Liegt eine Novation vor, ist dieses Feld ein Pflichtfeld.</i>
PTI der Gegenpartei (Counterparty Proprietary Transaction Identification)	Diese Variable enthält den individuellen PTI der Gegenpartei der betroffenen Transaktion. <i>Nur bei Verfügbarkeit zu melden.</i>
Gegenpartei	Diese Variable enthält den LEI der Gegenpartei des Berichtspflichtigen.

Variable	Beschreibung
(Counterparty Identification)	<p>Dieses Feld ist ein Pflichtfeld für alle Gegenparteien, die einen LEI besitzen. Handelt es sich bei der Gegenpartei um eine Zweigniederlassung ohne eigenen LEI, ist der LEI der Muttergesellschaft zu melden.</p> <p>Wird die Transaktion über eine zentrale Gegenpartei (central clearing counterparty; CCP) abgeschlossen, ist ebenfalls der LEI der CCP zu melden.</p> <p><i>Wenn die Gegenpartei keinen LEI besitzt, darf dieses Feld nicht im XML-Schema enthalten sein. Stattdessen werden die Felder „Sektor der Gegenpartei (Counterparty Sector)“ und „Sitzland der Gegenpartei (Counterparty Location)“ gemeldet.</i></p> <p>Diese Variable ist als „LEI“ in der MMSR message bezeichnet und befindet sich im Block „CounterpartyIdentification“.</p>
Sektor der Gegenpartei (Counterparty Sector)	<p>Mit dieser Variablen wird der Sektor der Gegenpartei, z. B. nichtfinanzielle Kapitalgesellschaft etc., angegeben.</p> <p><i>Der Sektor der Gegenpartei (Counterparty Sector) muss für alle Transaktionen gemeldet werden, bei der das Feld „Gegenpartei (Counterparty Identification)“ nicht gemeldet werden kann-</i></p> <p>Diese Variable ist als „Sector“ in der MMSR message bezeichnet und befindet sich unter „SectorAndLocation“ im Block „CounterpartyIdentification“.</p>
Sitzland der Gegenpartei (Counterparty Location)	<p>Hier wird der ISO Ländercode des Landes gemeldet, in dem der Geschäftspartner seinen Sitz hat.</p> <p><i>Das „Sitzland der Gegenpartei (Counterparty Location)“ muss für alle Transaktionen gemeldet werden, bei der das Feld „Gegenpartei (Counterparty Identification)“ nicht gemeldet werden kann-</i></p> <p>Diese Variable ist als „Location“ in der MMSR message bezeichnet und befindet sich unter „SectorAndLocation“ im Block „CounterpartyIdentification“.</p>
Identifikationskürzel für Tri-Party-Agenten (Triparty Agent Identification)	<p>Als Identifikationskürzel für Tri-Party-Agenten wird der entsprechende LEI gemeldet.</p>

Variable	Beschreibung
	<p><i>Für alle Tri-Party-Transaktionen ist dieses Feld ein Pflichtfeld. Für andere Transaktionen hat keine Meldung zu erfolgen.</i></p>
<p>Handelstag (Trade Date)</p>	<p>Beim Handelstag handelt es sich um den Tag und die Uhrzeit, an denen die Transaktion vereinbart wird. Sollte die Uhrzeit der Transaktion nicht bekannt sein, ist lediglich das Datum zu melden.</p> <p>Die zu meldende Uhrzeit ist – soweit verfügbar – die Ausführungs- oder anderweitig die Buchungszeit der Transaktion. Als Zeitinformation muss ein realer Zeitpunkt angegeben werden. Die Meldung eines Standardwerts (z.B. Mitternacht) ist nicht zulässig.</p> <p>Der Handelstag muss immer vor oder am Abwicklungstag liegen. Ausnahmen stellen Novations sowie Fälle, in denen die Gegenparteien eine vor dem Handelstag beginnende Zinszahlung vereinbart haben, dar. In diesen Fällen kann der Handelstag nach dem Abwicklungstag liegen.</p>
<p>Abwicklungstag (Settlement Date)</p>	<p>Der Abwicklungstag bezeichnet den Kauftag, d. h. den Tag, an dem der Kreditgeber den Betrag an den Kreditnehmer zu zahlen und der Kreditnehmer die Sicherheit an den Kreditgeber zu übertragen hat. Im Fall eines Rollover von Transaktionen bezeichnet der Abwicklungstag den Tag, an dem der Rollover durchgeführt wird. Falls die Abwicklung an einem anderen Tag als ursprünglich vereinbart stattfindet, ist keine Korrektur (Amendment, „AMND“) erforderlich.</p>
<p>Fälligkeitstag (Maturity Date)</p>	<p>Der Fälligkeitstag bezeichnet den Rückkaufstag, d. h. den Tag, an dem der Geldbetrag fällig und vom Kreditnehmer an den Kreditgeber zurückzuzahlen ist und die Rückgabe der Sicherheiten erfolgt.</p> <p>BAW-Geschäfte sind mit einer Overnight-Fälligkeit zu melden. Für den Fall, dass keine Overnight-Fälligkeit vereinbart worden ist (Geschäfte mit Kündigungsfrist), ist der erste Tag anzugeben, an dem das Geschäft gekündigt werden kann. Bei Fixed Term Evergreens stellt der Fälligkeitstag den Tag dar, an dem das Geschäft frühestens beendet werden kann und <u>nicht</u> das fest vereinbarte Ende des Geschäfts.</p>
<p>Art der Transaktion (Transaction Type)</p>	<p>Die Art der Transaktion sagt aus, ob es sich um eine Geldvergabe „lending (LEND)“ oder um eine Geldaufnahme „borrowing (BORR)“ handelt.</p>
<p>Nennwert der Transaktion (Transaction Nominal Amount)</p>	<p>Der Nennwert der Transaktion ist der Absolutbetrag (in Euro), der ursprünglich aufgenommen oder bereitgestellt wurde.</p> <p>In der MMSR message muss spezifiziert werden, dass die Währung</p>

Variable	Beschreibung
	Euro ist.
Art des Zinssatzes (Rate Type)	Die Art des Zinssatzes gibt an, ob ein Festzinssatz oder ein variabler Zinssatz vereinbart wurde.
Zinssatz der Transaktion (Deal Rate)	<p>Diese Variable bezeichnet den Zinssatz gemäß der ACT/360-Geldmarktkonvention, zu dem das Repogeschäft abgeschlossen wurde und der aufgenommene Geldbetrag verzinst wird.</p> <p>Wurde statt einer Zinszahlung eine Gebühr vereinbart, so ist diese in einen Zinssatz als Verhältnis aus der Gebühr und dem Nennwert der Transaktion gemäß der ACT/360-Geldmarktkonvention umzurechnen. Meldepflichtig sind nur tatsächlich zu zahlende Zinssätze, keine Schätzungen.</p> <p>Der Zinssatz kann entweder positiv oder negativ sein – unabhängig davon, ob Geld aufgenommen oder bereitgestellt wird, d. h. unabhängig davon ob die Art der Transaktion (Transaction Type) als „borrowing (BORR)“ oder „lending (LEND)“ gemeldet wird.</p> <p><i>Dieses Feld ist nur bei Repogeschäften mit fester Verzinsung zu melden.</i></p>
Referenzzinssatz (Reference Rate Index)	<p>Diese Variable beschreibt den Referenzzinssatz, auf dessen Basis die periodischen Zinszahlungen vereinbart wurden.</p> <p>Eine Liste der ISIN Codes für die verschiedenen Referenzzinssätze befindet sich im Anhang 4.</p> <p><i>Dieses Feld ist nur bei Repogeschäften mit variabler Verzinsung zu melden.</i></p> <p>Diese Variable befindet sich im Block „FloatingRateRepurchaseAgreement“ der MMSR message.</p>
Spread in Basispunkten (Basis Point Spread)	<p>Diese Variable gibt die Anzahl der Basispunkte an, die auf den zu Grunde liegenden Referenzzinssatz aufgeschlagen (positiver Wert) oder von diesem abgezogen (negativer Wert) werden, um den tatsächlichen Zinssatz für eine vorgegebene Periode zu ermitteln.</p> <p>Eine Gebühr, die neben dem Basis Point Spread für das Wertpapierleihgeschäft zu entrichten ist, darf beim Ausweis des Basis Point Spreads nicht berücksichtigt werden.</p> <p><i>Dieses Feld wird nur bei Geschäften mit variabler Verzinsung gemeldet.</i></p>

Variable	Beschreibung
	<p>Diese Variable ist als „FloatingRateNote“ in der MMSR message bezeichnet.</p>
<p>ISIN der Sicherheiten (Collateral ISIN)</p>	<p>In diesem Feld ist die International Securities Identification Number (ISIN) der Sicherheiten zu melden.</p> <p>Das Feld kann in drei Kategorien unterteilt werden:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Eine einzelne Sicherheit wird über die entsprechende ISIN identifiziert und gemeldet. - Mehrere Sicherheiten werden gemeldet, wenn diese über einzelne ISINs identifiziert werden können. Hierzu ist eine wiederholte Meldung des Feldes möglich. - Ein Sicherheitenpool (Basket) wird gemeldet, wenn die Sicherheiten derart zusammengefasst sind. In diesem Fall wird die ISIN des Sicherheitenpools gemeldet. <p><i>Dieses Feld ist optional für:</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1) <i>Tri-Party-Repos, die nicht mit einem Sicherheitenpool besichert sind, der über eine ISIN verfügt.</i> 2) <i>Sicherheiten, die nicht über eine ISIN verfügen.</i> <p><i>Sofern das Feld „ISIN der Sicherheit (Collateral ISIN)“ nicht gemeldet wird, müssen im Block „Other Collateral“ die Felder Sicherheitenpool (Collateral Pool)“, „Art der Sicherheit (Collateral Type)“ und „Sektor des Emittenten der Sicherheit (Collateral Issuer Sector)“ gemeldet werden.</i></p> <p>Diese Variable wird als „ISIN“ in der MMSR message bezeichnet und befindet sich im „Valuation“ Block im Block „Collateral“ in der MMSR message.</p>
<p>Sicherheitenpool (Collateral Pool)</p>	<p>Die Variable gibt an, ob es sich bei der gestellten Sicherheit um einen Sicherheitenpool handelt.</p> <p><i>Bei diesem Feld handelt es sich um ein Pflichtfeld, sofern die zu meldende Sicherheit nicht über eine ISIN verfügt. Sind individuelle ISINs vorhanden, muss dieses Feld nicht gemeldet werden.</i></p> <p>Diese Variable befindet sich im Block „OtherCollateral“ der MMSR message und ist als „PoolStatus“ bezeichnet.</p>
<p>Art der Sicherheit (Collateral Type)</p>	<p>Diese Variable dient dazu, die Kategorie des als Sicherheit hinterlegten</p>

Variable	Beschreibung
	<p>Vermögenswertes zu bestimmen, wenn keine individuelle ISIN angegeben werden kann.</p> <p>Besteht ein Pool aus verschiedenen Vermögensarten, so ist die Art anzugeben, welche den größten Anteil im Sicherheitenpool ausmacht.</p> <p><i>Bei diesem Feld handelt es sich um ein Pflichtfeld, sofern die zu meldende Sicherheit nicht über eine ISIN verfügt. Sind individuelle ISINs vorhanden, darf dieses Feld nicht gemeldet werden.</i></p> <p>Diese Variable befindet sich im Block „OtherCollateral“ der MMSR message und ist als „Type“ bezeichnet.</p>
Sektor des Emittenten der Sicherheit (Collateral Issuer Sector)	<p>Diese Variable beschreibt den Sektor des Emittenten der Sicherheit, z. B. Staat, Zentralbank etc.</p> <p><i>Bei diesem Feld handelt es sich um ein Pflichtfeld, sofern die zu meldende Sicherheit nicht über eine ISIN verfügt. Sind individuelle ISINs vorhanden, darf dieses Feld nicht gemeldet werden.</i></p> <p>Diese Variable befindet sich im Block „OtherCollateral“ der MMSR message und ist als „Sector“ bezeichnet.</p>
Kennzeichen für Special Collateral (Special Collateral Indicator)	<p>Diese Variable dient dazu, sämtliche Repogeschäfte, die gegen allgemeine oder spezielle Sicherheiten abgeschlossen wurden sowie Wertpapierleihen zu identifizieren,</p> <ul style="list-style-type: none"> - Eine allgemeine Sicherheit („General Collateral“) bezeichnet eine Sicherheit eines Reposgeschäfts, bei der der Sicherheitsgeber eine konkrete Sicherheit aus einem größeren Pool aussuchen kann; - Bei einer speziellen Sicherheit („Special Collateral“) eines Reposgeschäfts ist hingegen ein konkretes Wertpapier mit einer individuellen ISIN zu liefern. - Eine Wertpapierleihe („Matched and reverse repurchase agreement“) ist meldepflichtig, sobald die Wertpapiere gegen Cash getauscht werden. <p><i>Dieses Feld ist optional, sollte jedoch gemeldet werden, sofern das Kennzeichen bekannt ist</i></p> <p>Diese Variable befindet sich im Block „Collateral“ der MMSR message.</p>
Nennwert der Sicherheit (Collateral Nominal Amount)	<p>In diesem Feld wird der Nennwert der Sicherheiten in Euro gemeldet.</p> <p><i>Dieses Feld ist nicht zu melden, sofern es sich um eine Tri-Party-Transaktion handelt oder die der Transaktion zugrundeliegende Sicherheit</i></p>

Variable	Beschreibung
	<p><i>nicht über eine eigene ISIN zu identifizieren ist.</i></p> <p>Falls mehrere Sicherheiten gestellt werden, muss der Nennwert jeder einzelnen Sicherheit in die Meldung einfließen. Hierfür kann dieses Feld wiederholt gemeldet werden.</p> <p>Am Berichtstag ist der Gesamtbetrag als absoluter Wert (d. h. als nicht-negativer Wert) in Euro zu melden.</p> <p>Wird als Sicherheit ein Asset-Backed Security (ABS) verwendet, muss der Sicherheitennennwert durch die Multiplikation der Sicherheit mit dem entsprechenden Pool-Faktor berechnet werden. Sind stücknotierte Papiere als Sicherheit hinterlegt worden, wird in diesem Fall die Anzahl der Stücke mit dem Preis multipliziert, um den Nennwert der Sicherheit zu erhalten.</p> <p>Diese Variable ist als „NominalAmount“ in der MMSR message bezeichnet. In der MMSR message muss gekennzeichnet werden, dass es sich bei der Währung um Euro handelt.</p>
<p>Sicherheitsabschlag (Collateral Haircut)</p>	<p>Diese Variable bezeichnet eine auf die gestellte Sicherheit angewandte Risikokontrollmaßnahme, wobei der Wert einer Sicherheit als deren Marktwert abzüglich eines bestimmten Prozentsatzes (Sicherheitsabschlag) berechnet wird. Zu Meldezwecken wird der Sicherheitsabschlag berechnet als 100 abzüglich der Quote zwischen dem aufgenommen/bereitgestellten Geldbetrag und dem Marktwert einschließlich der aufgelaufenen Zinsen der verpfändeten Sicherheit.</p> <p>Werden mehrere Sicherheiten gestellt (Multi Collateral Repo), muss die Quote zwischen dem aufgenommenen/bereitgestellten Geldbetrag und dem Marktwert einschließlich der aufgelaufenen Stückzinsen der verpfändeten Sicherheit für jede Sicherheit berechnet werden und der Sicherheitsabschlag als Durchschnittswert angegeben werden.</p> <p>Meldepflichtig sind nur tatsächliche Abschläge; keine Schätzungen und keine Default-Werte.</p> <p>Der Sicherheitsabschlag wird wie folgt berechnet:</p> $\text{Sicherheitsabschlag} = 100 - \left(\frac{\text{Cash}}{\text{Marktwert}} * 100 \right)$ <p>Er gibt die Über- bzw. Unterdeckung des Sicherheitennennwerts im Verhältnis zum Cash-Betrag an. Ein Haircut von z.B. 5% ist mit dem Wert 5 zu melden.</p> <p>Der Wert kann positiv oder negativ sein.</p>

Variable	Beschreibung
	<p><i>Die Meldung dieses Feldes ist nur für Transaktionen mit einer einzigen Sicherheit verpflichtend. In allen anderen Fällen, z. B. bei Tri-Party-Repос bzw. bei Sicherheitenpools ist eine Meldung optional.</i></p> <p>Diese Variable befindet sich im Block „Collateral“ der MMSR message und ist als „Haircut“ bezeichnet.</p>

4. Konzeptionelle Definitionen für das unbesicherte Marktsegment

4.1 Erläuterungen zu den meldepflichtigen Instrumenten im unbesicherten Segment

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

- Jegliche auf Euro lautende **Geldaufnahme** des Berichtspflichtigen unter Verwendung der in folgender Tabelle beschriebenen Instrumente mit einer Laufzeit bis einschließlich 397 Tage nach dem Abwicklungstag von sämtlichen finanziellen Gegenparteien (ausgenommen sind Transaktionen mit Zentralbanken, die nicht zu Investitionszwecken getätigt werden), dem Staat sowie von nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, die gemäß dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk als „Großkunden“ gelten.
- Jegliche auf Euro lautende **Geldvergabe** an andere Kreditinstitute unter Verwendung der in folgender Tabelle beschriebenen Instrumente mit einer Laufzeit bis einschließlich 397 Tage nach dem Abwicklungstag von emittierenden Kreditinstituten.

Folgende **Instrumente** sind zu melden:

Instrument	Beschreibung
Einlagen (Deposit)	Unbesicherte, verzinsliche Einlagen mit einer Kündigungsfrist oder einer Laufzeit bis einschließlich 397 Tage nach dem Abwicklungstag, die entweder von dem Berichtspflichtigen heringenommen (Geldaufnahme) oder platziert (Geldvergabe) werden.
Tagesgelder (Call Account/ Call Money)	Konten mit einer Kündigungsfrist, bei denen der Zinssatz täglich geändert werden kann. Darunter fallen Tagesgelder und Sparkonten.

Instrument	Beschreibung
Einlagenzertifikat (Certificate of Deposit)	Ein von einem MFI ausgegebener (entweder übertragbarer oder nicht übertragbarer) Schuldtitel mit fester Laufzeit bis einschließlich 397 Tage nach dem Abwicklungstag, der entweder festverzinslich oder diskontiert ist.
Commercial Paper	Ein unbesicherter Schuldtitel, der eine Laufzeit bis einschließlich 397 Tage nach dem Abwicklungstag hat und entweder verzinslich oder diskontiert ist.
Asset Backed Commercial Paper	Ein von Kreditinstituten emittierter Schuldtitel, der eine Laufzeit bis einschließlich 397 Tage nach dem Abwicklungstag hat, welcher entweder verzinslich oder diskontiert ist und bei dem die Zahlungsansprüche durch einen Bestand an Forderungen gedeckt werden.
Variabel verzinsliche Schuldverschreibungen (Floating Rate Note)	Ein Schuldtitel, für den die periodischen Zinszahlungen durch die Festlegung (sogenanntes Fixing) eines zugrunde liegenden Referenzzinssatzes (wie etwa Euribor), zu im Voraus festgelegten Tagen (sogenannten Fixing-Terminen) berechnet werden, und der eine Laufzeit bis einschließlich 397 Tage nach dem Abwicklungstag aufweist.
Andere unbesicherte Geschäfte (Other Short-term Debt Securities Issued)	<p>Nichtnachrangige Schuldverschreibungen außer sonstigen Anteilsrechten mit einer Laufzeit bis einschließlich 397 Tage nach dem Abwicklungstag; dabei handelt es sich um Finanzinstrumente, die in der Regel handelbar sind und an Sekundärmärkten gehandelt werden oder am Markt verrechnet werden können, dem Inhaber aber keine Eigentumsrechte am Emissionsinstitut einräumen. Hierunter fallen:</p> <p>a) Wertpapiere, die dem Inhaber ein uneingeschränktes Recht auf ein festes oder vertraglich vereinbartes Einkommen in Form von Kuponzahlungen und/oder einem angegebenen festen Betrag zu einem bestimmten Tag (oder bestimmten Tagen) oder ab einem zum Zeitpunkt der Emission festgelegten Tag einräumen;</p> <p>b) Nicht börsenfähige Instrumente, die zu einem späteren Zeitpunkt börsenfähig werden und als „Schuldverschreibungen“ reklassifiziert werden. Diese spätere Reklassifizierung ist nicht zu melden.</p>

4.2 Meldung von Tagesgeldern und Sparkonten

4.2.1 Tagesgelder

Tagesgelder sind täglich als neue Transaktion mit der Transaktionskennung „NEWT“ und neuem PTI zu melden, wobei der Handels-, Abwicklungs- und Fälligkeitstag jeweils rolliert werden muss. Rückführungen sind nicht als gesonderte Transaktion auszuweisen. Tagesgelder sind mit einer Overnight-Fälligkeit zu melden. Für den Fall, dass keine Overnight-Fälligkeit vereinbart worden ist, ist der erste Tag anzugeben, an dem über das Geld verfügt werden kann.

Eine Meldung hat bis zur endgültigen Fälligkeit des Geschäfts zu erfolgen. Die Beendigung selbst unterliegt nicht der Meldepflicht. Tagesgeldkonten, die vor dem 1. April 2016 eröffnet worden sind und aktuell noch bestehen, müssen ebenfalls gemeldet werden.

Es sind täglich sämtliche Bestände (am Ende des Geschäftstages) der Tagesgelder meldepflichtiger Sektoren berichtspflichtig und nicht die einzelnen Kapitalveränderungen innerhalb eines Tages. Änderungen der Geschäftskonditionen (z.B. Neuverhandlung des Zinssatzes) sind in die Meldung des Rollovers einzubeziehen zu welcher die Änderung wirksam wird. Als Zinssatz soll der aktuell für dieses Geschäft gültige Zinssatz ausgewiesen werden.

Die Felder „Call or Put“ (Kauf bzw. Verkaufsoption) und „Call/Put Notice Period“ (Kauf- bzw. Verkaufsfrist) sind für Tagesgelder nicht zu melden.

Beispiel 1: Meldung eines Tagesgeldkontos

Tag	Handelstag	Abwicklungstag	Fälligkeitstag	Betrag	PTI	Kommentar
T	T	T	T+1	100.000	“A1”	Meldung Eröffnung Tagesgeldkonto
T+1	T+1	T+1	T+2	100.000	“A2”	Rollover
T+2	T+2	T+2	T+3	150.000	“A3”	Rollover und zusätzliche Erhöhung des Volumens um 50.000
T+3	T+3	T+3	T+4	30.000	“A4”	Teilabruf von 120.000
T+4						Beendigung der Anlage: Keine Meldung

4.2.2 Sparkonten

Sparkonten mit einer Kündigungsfrist¹⁴ sind täglich als neue Transaktion mit der Transaktionskennung „NEWT“ und neuem PTI zu melden, wobei der Handels-, Abwicklungs- und Fälligkeitstag jeweils rolliert werden muss. Sparkonten ohne Kündigungsfrist fallen nicht unter die

¹⁴ Die Kündigungsfrist ist eine vom Kunden einzuhaltende Frist, bevor die Verfügung über den gekündigten Betrag möglich ist. Nach dieser Frist kann das Konto geschlossen werden oder bestehen bleiben.

Meldepflicht zur Geldmarktstatistik. Rückführungen sind nicht als gesonderte Transaktion auszuweisen.

Als Fälligkeitstag von Sparkonten wird der Tag angegeben, an dem zuerst über das Geld verfügt werden könnte (i. d. R. 3 Monate nach Hereinnahme). Die Laufzeit dieses Geschäfts wird somit durch die Kündigungsfrist bestimmt. Kündigt der Kunde die Spareinlage, erfolgt die Meldung des Geschäfts täglich als NEWT bis zum Ende der Kündigungsfrist weiter. Es ist zu beachten, dass die Ursprungslaufzeit weiter gemeldet werden soll und nicht auf die verbleibenden Tage der Kündigungsfrist zu verkürzen ist. Ein gesonderter Ausweis des vorschusszinsfreien Betrags ist nicht erforderlich.

Eine Meldung hat bis zur endgültigen Fälligkeit des Geschäfts zu erfolgen. Die Beendigung selbst unterliegt nicht der Meldepflicht. Sparkonten, die vor dem 1. April 2016 eröffnet worden sind und aktuell noch bestehen, müssen ebenfalls gemeldet werden.

Es sind täglich sämtliche Bestände (am Ende des Geschäftstages) der Sparkonten meldepflichtiger Sektoren berichtspflichtig und nicht die einzelnen Kapitalveränderungen innerhalb eines Tages. Änderungen der Geschäftskonditionen (z.B. Neuverhandlung des Zinssatzes) sind in die Meldung des Rollovers einzubeziehen zu welcher die Änderung wirksam wird. Als Zinssatz soll der aktuell für dieses Geschäft gültige Zinssatz ausgewiesen werden.

Die Felder „Call or Put“ (Kauf bzw. Verkaufsoption) und „Call/Put Notice Period“ (Kauf- bzw. Verkaufsfrist) sind für Sparkonten nicht zu melden.

Beispiel 2: Meldung eines Sparkontos mit einer fiktiven Kündigungsfrist von 3 Tagen:

Tag	Handelstag	Abwicklungstag	Fälligkeits-tag	Betrag	PTI	Kommentar
T	T	T	T+3	100.000	„A1“	Meldung Sparkontoeröffnung
T+1	T+1	T+1	T+4	100.000	„A2“	Rollover
T+2	T+2	T+2	T+5	150.000	„A3“	Rollover und zusätzl. Erhöhung des Volumens um 50.000
T+3	T+3	T+3	T+6	30.000	„A4“	Teilabruf von 120.000
T+4	T+4	T+4	T+7	30.000	„A5“	Kündigung
T+5	T+5	T+5	T+8	30.000	„A6“	Änderung des Volumens ist nicht mehr möglich (Rollover)
T+6	T+6	T+6	T+9	30.000	„A7“	Änderung des Volumens ist nicht mehr möglich (Rollover)
T+7						Beendigung der Anlage: Keine Meldung

4.3 Primärmarkt

Im Marktsegment unbesicherter Geldmarkt sind ausschließlich Geschäfte zu melden, welche am **Primärmarkt** getätigt wurden. Hierunter fallen eigene Emissionen bzw. Transaktionen, die mit emittierenden Kreditinstituten abgeschlossen werden und bei denen der Abwicklungstag (Settlement Date) der Emissionstag ist. Entsprechend sind nur Geschäfte zu melden, bei denen keine Stückzinsen aufgelaufen sind und die eine Laufzeit bis einschließlich 397 Tage nach dem Abwicklungstag haben. Transaktionen, die nach dem Emissionstag durchgeführt werden, sind hingegen nicht in die Meldung einzubeziehen.

Folgende zwei Formen von Primärmarkttransaktionen sollen gemeldet werden:

- (a) Die Emission von kurzfristigen Papieren (Geldaufnahme). Ausgenommen sind der Rück- und Wiederverkauf der Papiere, da es sich bei diesen Transaktionen um Sekundärmarktgeschäfte handelt.
- (b) Der Kauf von kurzfristigen Papieren auf dem Primärmarkt (Geldvergabe). Ausgenommen ist der Kauf von einem Dritten, da es sich bei dieser Transaktion um ein Sekundärmarktgeschäft handelt.

Geschäfte auf dem grauen Markt sind nicht meldepflichtig.

4.4 Erläuterungen der zu meldenden Variablen im unbesicherten Segment

Die zu meldenden Variablen und entsprechende Erläuterungen sind in der folgenden Tabelle aufgeführt:

Variable	Beschreibung
Transaktionsstatus (Reported Transaction Status)	Diese Variable enthält Informationen über den Status der Transaktion, d. h. ob es sich um eine neue Transaktion (new transaction, „NEWT“), eine Korrektur (amendment, „AMND“ oder correction, „CORR“) oder eine Transaktionslöschung (cancellation, „CANC“) handelt.
Novation Status (No- novation Status)	Diese Variable spezifiziert, ob es sich bei der Transaktion um eine Novation handelt oder nicht. <i>Liegt eine Novation vor, ist dieses Feld ein Pflichtfeld. Die Angabe des Novation Status wird auch für alle anderen Transaktionen empfohlen.</i>
Transaktionskennung (Unique Transaction Identifier; UTI)	Diese Variable enthält den UTI, bei dem es sich um eine eindeutige Identifikationskennung einer Transaktion handelt. Zu melden, wenn UTI zum Zeitpunkt der Meldungseinreichung verfügbar ist.
Interne Transaktionskennung (Proprietary Transaction Identification; PTI)	Der PTI ist eine eindeutige interne Transaktionskennung des Berichtspflichtigen, welche für jede Transaktion zu melden ist und pro Berichtspflichtigen sowie pro Marktsegment einmalig sein muss.
Zugehörige interne Transaktionskennung (Related Proprietary Transaction Identification)	Die zugehörige interne Transaktionskennung ist die PTI der ursprünglichen Transaktion, die durch eine Novation ersetzt wurde. <i>Liegt eine Novation vor, ist dieses Feld ein Pflichtfeld.</i>
PTI der Gegenpartei (Counterparty Proprietary Transaction Identification)	Diese Variable enthält den individuellen PTI der Gegenpartei der betroffenen Transaktion. <i>Nur bei Verfügbarkeit zu melden.</i>

Variable	Beschreibung
<p>Gegenpartei (Counterparty Identification)</p>	<p>Diese Variable enthält den LEI der Gegenpartei des Berichtspflichtigen.</p> <p>Dieses Feld ist ein Pflichtfeld für alle Gegenparteien, die einen LEI besitzen. Handelt es sich bei der Gegenpartei um eine Zweigniederlassung ohne eigenen LEI, ist der LEI der Muttergesellschaft zu melden.</p> <p>Wird die Transaktion über eine zentrale Gegenpartei (central clearing counterparty; CCP) abgeschlossen, ist ebenfalls der LEI der CCP zu melden.</p> <p><i>Wenn die Gegenpartei keinen LEI besitzt, darf dieses Feld nicht im XML-Schema enthalten sein. Stattdessen werden die Felder „Sektor der Gegenpartei (Counterparty Sector)“ und „Sitzland der Gegenpartei (Counterparty Location)“ gemeldet.</i></p> <p>Diese Variable ist als „LEI“ in der MMSR message bezeichnet und befindet sich im Block „CounterpartyIdentification“.</p>
<p>Sektor der Gegenpartei (Counterparty Sector)</p>	<p>Mit dieser Variablen wird der Sektor der Gegenpartei, z. B. nichtfinanzielle Kapitalgesellschaft etc., angegeben.</p> <p><i>Der Sektor der Gegenpartei (Counterparty Sector) muss für alle Transaktionen gemeldet werden, bei der das Feld „Gegenpartei (Counterparty Identification)“ nicht gemeldet werden kann.</i></p> <p>Diese Variable ist als „Sector“ in der MMSR message bezeichnet und befindet sich unter „SectorAndLocation“ im Block „CounterpartyIdentification“.</p>
<p>Sitzland der Gegenpartei (Counterparty Location)</p>	<p>Hier wird der ISO Ländercode des Landes gemeldet, in dem der Geschäftspartner seinen Sitz hat.</p> <p><i>Das „Sitzland der Gegenpartei (Counterparty Location)“ muss für alle Transaktionen gemeldet werden, bei der das Feld „Gegenpartei (Counterparty Identification)“ nicht gemeldet werden kann.</i></p> <p>Diese Variable ist als „Location“ in der MMSR message bezeichnet und befindet sich unter „SectorAndLocation“ im Block „CounterpartyIdentification“.</p>

Variable	Beschreibung
Handelstag (Trade Date)	<p>Beim Handelstag handelt es sich um den Tag und die Uhrzeit an denen die Transaktion vereinbart wird. Sollte die Uhrzeit der Transaktion nicht bekannt sein, ist lediglich das Datum zu melden.</p> <p>Die zu meldende Uhrzeit ist – soweit verfügbar – die Ausführungs- oder anderweitig die Buchungszeit der Transaktion. Als Zeitinformation muss ein realer Zeitpunkt angegeben werden. Die Meldung eines Standardwerts (z.B. Mitternacht) ist nicht zulässig.</p> <p>Der Handelstag muss immer vor oder am Abwicklungstag liegen. Ausnahmen stellen Novations sowie Fälle, in denen die Gegenparteien eine vor dem Handelstag beginnende Zinszahlung vereinbart haben, dar. In diesen Fällen kann der Handelstag nach dem Abwicklungstag liegen.</p>
Abwicklungstag (Settlement Date)	<p>Der Abwicklungstag bezeichnet den Tag, an dem das Geld zwischen den beteiligten Geschäftspartnern ausgetauscht wird oder an dem der Kauf- bzw. Verkauf von Schuldtiteln abgewickelt wird. In Bezug auf Tagesgelder und andere Instrumente mit Kündigungsfrist bezeichnet die Variable den Tag, an dem die Einlage verlängert wird. Falls die Abwicklung an einem anderen Tag als ursprünglich vereinbart stattfindet, ist keine Meldung eines Amendments erforderlich.</p>
Fälligkeitstag (Maturity Date)	<p>Der Fälligkeitstag bezeichnet den Tag, an dem der Geldbetrag fällig und vom Kreditnehmer an den Kreditgeber zurückzuzahlen ist oder an dem ein Schuldtitel fällig wird und zurückzuzahlen ist.</p> <p>In Bezug auf Put- bzw. Call-Instrumente muss das Datum der Endfälligkeit angegeben werden. Tagesgelder sind mit einer Overnight-Fälligkeit zu melden. Für den Fall, dass keine Overnight-Fälligkeit vereinbart worden ist, ist der Tag anzugeben, an dem über das Geld verfügt werden kann. Bei der Meldung von Sparbüchern soll die Laufzeit die Länge der Kündigungsfrist widerspiegeln.</p>
Art des Instruments (Instrument Type)	<p>Die Art des Instruments der Transaktion soll nach den Vorgaben in Kapitel 4.1 angegeben werden.</p>
Art der Transaktion (Transaction Type)	<p>Die Art der Transaktion sagt aus, ob es sich um eine Geldvergabe („lending (LEND)“) oder Geldaufnahme („borrowing (BORR)“) handelt.</p>

Variable	Beschreibung
Nennwert der Transaktion (Transaction Nominal Amount)	<p>Der Nennwert der Transaktion bezeichnet den als Einlagen aufgenommenen oder bereitgestellten Geldbetrag, bei Schuldverschreibungen den Nennwert des ausgegebenen/erworbenen Wertpapiers.</p> <p>In der MMSR message muss gekennzeichnet werden, dass es sich bei der Währung um Euro handelt.</p>
Preis der Transaktion (Transaction Deal Price)	<p>Diese Variable bezeichnet den Preis (dirty price) in Prozentpunkten, zu dem das Wertpapier ausgegeben oder gehandelt wird. Für unbesicherte Einlagen ist 100 zu melden.</p> <p>Diese Variable ist als „DealPrice“ in der MMSR message bezeichnet.</p>
Art des Zinssatzes (Rate Type)	<p>Die Art des Zinssatzes gibt an, ob ein Festzinssatz oder ein variabler Zinssatz vereinbart wurde.</p>
Zinssatz der Transaktion (Deal Rate)	<p>Der Zinssatz der Transaktion bezeichnet den gemäß der Konvention ACT/360 vereinbarten Zinssatz für die Geldanlage bzw. die Geldvergabe.</p> <p>Bei Schuldtiteln ist die Effektivverzinsung, zu dem das Instrument ausgegeben oder erworben wurde, gemäß der Konvention ACT/360 zu melden.</p> <p>Der Zinssatz kann entweder positiv oder negativ sein – unabhängig davon, ob Geld aufgenommen oder bereitgestellt wird, d. h. unabhängig davon ob die Art der Transaktion (transaction type) als „borrowing (BORR)“ oder „lending (LEND)“ gemeldet wird.</p> <p><i>Dieses Feld ist nur zu melden, wenn als RATE TYPE „FIXE“ angegeben ist.</i></p>
Referenzzinssatz (Reference Rate Index)	<p>Diese Variable beschreibt den Referenzzinssatz, auf dessen Basis die periodischen Zinszahlungen vereinbart werden.</p> <p>Eine Liste der ISIN Codes für die verschiedenen Referenzzinssätze befindet sich im Anhang 4.</p> <p><i>Dieses Feld wird nur bei Geschäften mit variabler Verzinsung gemeldet.</i></p> <p>Diese Variable ist als „FloatingRateNote“ in der MMSR message bezeichnet.</p>

Variable	Beschreibung
Spread in Basispunkten (Basis Point Spread)	<p>Diese Variable gibt die Anzahl der Basispunkte an, die auf den zu Grunde liegenden Referenzzinssatz aufgeschlagen (positiver Wert) oder von diesem abgezogen (negativer Wert) werden, um den tatsächlichen Zinssatz für eine vorgegebene Periode zu ermitteln.</p> <p><i>Dieses Feld wird nur bei Geschäften mit variabler Verzinsung gemeldet.</i></p> <p>Diese Variable ist als „FloatingRateNote“ in der MMSR message bezeichnet.</p>
Kauf- bzw. Verkaufsoption (Call or Put)	<p>Bei dieser Variablen handelt es sich um die Kennzeichnung, ob das Instrument eine Kauf- oder Verkaufsoption hat. Sofern das Instrument sowohl eine Kauf- als auch eine Verkaufsoption hat, müssen diese beiden Möglichkeiten gemeldet werden.</p> <p><i>Dieses Feld ist nur bei Kauf- bzw. Verkaufsoptionen zu melden. Wenn es sich um eine Kauf- bzw. Verkaufsoption handelt, muss mindestens eines der Felder „Erster Kauf- bzw. Verkaufstag (First call/put date)“ oder „Kauf- bzw. Verkaufsfrist (Call/put notice period)“ gemeldet werden. Diese Variable darf nicht gemeldet werden, wenn als Instrumententyp „CACM“ (Tagesgelder und Sparkonten) ausgewiesen ist.</i></p> <p>Diese Variable ist als „Type“ in der MMSR message bezeichnet und befindet sich im Block „CallPutOption“.</p>
Erster Kauf- bzw. Verkaufstag (First Call/Put Date)	<p>Diese Variable kennzeichnet den ersten Tag, an dem die Kauf-/Verkaufsoption ausgeübt werden darf.</p> <p><i>Dieses Feld ist meldepflichtig, sofern die Kauf- bzw. Verkaufsoption an einem oder mehreren feststehenden Kauf- bzw. Verkaufstagen ausgeübt werden kann. Diese Variable darf nicht gemeldet werden, wenn als Instrumententyp „CACM“ (Tagesgelder und Sparkonten) ausgewiesen ist.</i></p> <p>Diese Variable ist als „EarliestExerciseDate“ in der MMSR message bezeichnet und befindet sich im Block „CallPutOption“.</p>

Variable	Beschreibung
Kauf- bzw. Verkaufsfrist (Call/Put Notice Period)	<p>Bei abrufbaren/kündbaren Instrumenten kennzeichnet diese Variable die Anzahl der Kalendertage vor dem Tag, an dem die Option ausgeübt werden kann, die der Inhaber dieser Option einzuhalten hat, um den Inhaber/Emittenten zu benachrichtigen.</p> <p><i>Dieses Feld ist meldepflichtig, sofern die Kauf- bzw. Verkaufsoption eine Kauf- bzw. Verkaufsfrist hat und für Einlagen mit einer Kündigungsfrist, d. h. Einlagen, bei denen der Inhaber dieser Option eine bestimmte Anzahl von Kalendertagen einhalten muss bevor die Option ausgeübt werden kann. Diese Variable darf nicht gemeldet werden, wenn als Instrumenten Typ „CACM“ (Tagesgelder und Sparkonten) ausgewiesen ist.</i></p> <p>Diese Variable ist als „NoticePeriod“ in der MMSR message bezeichnet und befindet sich im Block „CallPutOption“.</p>

5. Konzeptionelle Definitionen für das Segment der Devisenswap-Geschäfte

5.1 Meldung von Devisenswaps

Durch berichtspflichtige Institute sind alle relevanten Devisenswap-Transaktionen an die Deutsche Bundesbank zu melden, die eine Ursprungslaufzeit bis einschließlich 397 Tage nach dem Abwicklungstag haben. Meldepflichtig sind einzelne Transaktionen, bei denen Euro gegen eine Fremdwährung gekauft bzw. verkauft wird und an einem zukünftigen Zeitpunkt zu einem vorher festgelegten Devisenterminkurs wieder verkauft bzw. zurückgekauft wird, die mit sämtlichen finanziellen Gegenparteien (ausgenommen sind Transaktionen mit Zentralbanken, die im Rahmen geldpolitischer Operationen des Eurosystems über ein Tendersverfahren bzw. ständige Fazilitäten durchgeführt werden), dem Staat sowie nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, die gemäß dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk als „Großkunden“ gelten, durchgeführt wurden.

5.2 Erläuterungen der zu meldenden Variablen im Segment der Devisenswap-Geschäfte

Die zu meldenden Variablen und entsprechende Erläuterungen sind in der folgenden Tabelle aufgeführt:

Variable	Beschreibung
Transaktionsstatus (Reported Transaction Status)	Diese Variable enthält Informationen über den Status der Transaktion, d. h. ob es sich um eine neue Transaktion (new transaction, „NEWT“), eine Korrektur (amendment, „AMND“ oder correction, „CORR“) oder eine Transaktionslöschung (cancellation, „CANC“) handelt.

Variable	Beschreibung
	handelt.
Novation Status (Novation Status)	<p>Diese Variable spezifiziert, ob es sich bei der Transaktion um eine Novation handelt oder nicht.</p> <p><i>Liegt eine Novation vor, ist dieses Feld ein Pflichtfeld. Die Angabe des Novation Status wird auch für alle anderen Transaktionen empfohlen.</i></p>
Transaktionskennung (Unique Transaction Identifier; UTI)	<p>Diese Variable enthält den UTI, bei dem es sich um eine eindeutige Identifikationskennung einer Transaktion handelt.</p> <p>Zu melden, wenn UTI zum Zeitpunkt der Meldungseinreichung verfügbar ist.</p>
Interne Transaktionskennung (Proprietary Transaction Identification; PTI)	<p>Der PTI ist eine eindeutige interne Transaktionskennung des Berichtspflichtigen, welche für jede Transaktion zu melden ist und pro Berichtspflichtigen sowie pro Marktsegment einmalig sein muss.</p>
Zugehörige interne Transaktionskennung (Related Proprietary Transaction Identification)	<p>Die zugehörige interne Transaktionskennung ist die PTI der ursprünglichen Transaktion, die durch eine Novation ersetzt wurde.</p> <p><i>Liegt eine Novation vor, ist dieses Feld ein Pflichtfeld.</i></p>
PTI der Gegenpartei (Counterparty Proprietary Transaction Identification)	<p>Diese Variable enthält den individuellen PTI der Gegenpartei der betroffenen Transaktion.</p> <p><i>Nur bei Verfügbarkeit zu melden.</i></p>
Gegenpartei (Counterparty Identification)	<p>Diese Variable enthält den LEI der Gegenpartei des Berichtspflichtigen.</p> <p>Dieses Feld ist ein Pflichtfeld für alle Gegenparteien, die einen LEI besitzen. Handelt es sich bei der Gegenpartei um eine Zweigniederlassung ohne eigenen LEI, ist der LEI der Muttergesellschaft zu melden.</p> <p>Wird die Transaktion über eine zentrale Gegenpartei (central clearing counterparty; CCP) abgeschlossen, ist ebenfalls der LEI der CCP zu melden.</p> <p><i>Wenn die Gegenpartei keinen LEI besitzt, darf dieses Feld nicht im</i></p>

Variable	Beschreibung
	<p><i>XML-Schema enthalten sein. Stattdessen werden die Felder „Sektor der Gegenpartei (Counterparty Sector)“ und „Sitzland der Gegenpartei (Counterparty Location)“ gemeldet.</i></p> <p>Diese Variable ist als „LEI“ in der MMSR message bezeichnet und befindet sich im Block „CounterpartyIdentification“.</p>
Sektor der Gegenpartei (Counterparty Sector)	<p>Mit dieser Variablen wird der Sektor der Gegenpartei, z. B. nichtfinanzielle Kapitalgesellschaft etc., angegeben.</p> <p><i>Der Sektor der Gegenpartei (Counterparty Sector) muss für alle Transaktionen gemeldet werden, bei der das Feld „Gegenpartei (Counterparty Identification)“ nicht zu gemeldet werden kann.</i></p> <p>Diese Variable ist als „Sector“ in der MMSR message bezeichnet und befindet sich unter „SectorAndLocation“ im Block „CounterpartyIdentification“.</p>
Sitzland der Gegenpartei (Counterparty Location)	<p>Hier wird der ISO Ländercode des Landes gemeldet, in dem der Geschäftspartner seinen Sitz hat.</p> <p><i>Das „Sitzland der Gegenpartei (Counterparty Location)“ muss für alle Transaktionen gemeldet werden, bei der das Feld „Gegenpartei (Counterparty Identification)“ nicht gemeldet werden kann.</i></p> <p>Diese Variable ist als „Location“ in der MMSR message bezeichnet und befindet sich unter „SectorAndLocation“ im Block „CounterpartyIdentification“.</p>
Handelstag (Trade Date)	<p>Beim Handelstag handelt es sich um den Tag und die Uhrzeit an denen die Transaktion vereinbart wird. Sollte die Uhrzeit der Transaktion nicht bekannt sein, ist lediglich das Datum zu melden.</p> <p>Die zu meldende Uhrzeit ist – soweit verfügbar – die Ausführungs- oder anderweitig die Buchungszeit der Transaktion. Als Zeitinformation muss ein realer Zeitpunkt angegeben werden. Die Meldung eines Standardwerts (z.B. Mitternacht) ist nicht zulässig.</p> <p>Der Handelstag muss immer vor oder am Abwicklungstag liegen. Ausnahmen stellen Novations sowie Fälle, in denen die Gegenparteien eine vor dem Handelstag beginnende Berechnung der entsprechenden Rates vereinbart haben, dar. In diesen Fällen kann der Handelstag nach dem Abwicklungstag liegen.</p>
Valuta (Spot Value Date)	<p>Diese Variable bezeichnet den Tag, an dem eine Partei der anderen Partei einen bestimmten Betrag einer bestimmten Währung gegen Zahlung eines vereinbarten Betrags einer bestimmten anderen</p>

Variable	Beschreibung
	Währung auf Grundlage eines vereinbarten Devisenkurses, des sogenannten Devisenkassakurses, veräußert.
Fälligkeitstag (Maturity Date)	Der Fälligkeitstag bezeichnet den Tag, an dem das Devisenswapgeschäft ausläuft und die am Kassa-Abrechnungstag verkaufte Währung zurückgekauft wird.
Art der Transaktion (FX Transaction Type)	<p>Die Art der Transaktion gibt an ob der als Transaktionsnennwert ausgewiesene Eurobetrag am Kassa-Abrechnungstag gekauft oder verkauft wird.</p> <p>Diese Variable ist als „TransactionType“ in der MMSR message bezeichnet.</p>
Nennwert der Transaktion (Transaction Nominal Amount)	<p>Diese Variable enthält den am Kassa-Abrechnungstag gekauften oder verkauften Eurobetrag.</p> <p>In der MMSR message muss gekennzeichnet werden, dass es sich bei der Währung um Euro handelt.</p>
ISO-Code der Fremdwährung (Foreign Currency Code)	<p>Diese Variable enthält das internationale dreistellige ISO-Kürzel der im Austausch gegen Euro gekauften/verkauften Währung.</p> <p>Diese Variable ist als „ForeignCurrency“ in der MMSR message bezeichnet und befindet sich im Block „ForeignExchange“.</p>
Devisenkassakurs (Foreign Exchange Spot Rate)	<p>Diese Variable enthält den vereinbarten Devisenkassakurs zwischen dem Euro und der Fremdwährung.</p> <p>Der Devisenkassakurs soll in Einheiten pro 1 EUR gemeldet werden. Dies gilt unabhängig von der vorherrschenden Marktkonvention für das jeweilige Währungspaar.</p> <p>Diese Variable ist als „ExchangeSpotRate“ in der MMSR message bezeichnet und befindet sich im Block „ForeignExchange“.</p>
Swap-Punkte (Foreign Exchange Forward Points)	<p>Diese Variable bezeichnet den Unterschied zwischen dem Kassa- und dem Terminkurs der Devisen, ausgedrückt in Basispunkten gemäß den vorherrschenden Marktkonventionen für das betreffende Währungspaar. Die anzuwendende Formel zur Berechnung der Swap-Punkte lautet: $[(\text{Devisenforwardkurs} - \text{Devisenkassakurs}) * \text{Multiplikator}]$</p> <p>Eine Liste der Multiplikatoren für die entsprechende Währung ist im Anhang 6 zu finden.</p>

Variable	Beschreibung
	<p>Der Wert kann positiv oder negativ sein.</p> <p>Diese Variable ist als „ExchangeForwardPoint“ in der MMSR message bezeichnet und befindet sich im Block „ForeignExchange“.</p>

6. Konzeptionelle Definitionen für das Segment der Overnight Index Swaps

6.1 Meldung von Overnight Index Swaps

Durch berichtspflichtige Institute sind alle relevanten Overnight Index Swaps an die Deutsche Bundesbank zu melden, unabhängig von ihrer Laufzeit. Meldepflichtig sind einzelne Transaktionen in Euro, die mit sämtlichen finanziellen Gegenparteien (ausgenommen sind Transaktionen mit Zentralbanken, die nicht zu Investitionszwecken getätigt werden), dem Staat sowie nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, die gemäß dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk als „Großkunden“ gelten, durchgeführt wurden.

6.2 Erläuterungen der zu meldenden Variablen im Segment der Overnight Index Swaps

Die zu meldenden Variablen und entsprechende Erläuterungen sind in der folgenden Tabelle aufgeführt:

Variable	Beschreibung
Transaktionsstatus (Reported Transaction Status)	Diese Variable enthält Informationen über den Status der Transaktion, d. h. ob es sich um eine neue Transaktion (new transaction, „NEWT“), eine Korrektur (amendment, „AMND“ oder correction, „CORR“) oder eine Transaktionslöschung (cancellation, „CANC“) handelt.
Novation Status (No- novation Status)	<p>Diese Variable spezifiziert, ob es sich bei der Transaktion um eine Novation handelt oder nicht.</p> <p><i>Liegt eine Novation vor, ist dieses Feld ein Pflichtfeld. Die Angabe des Novation Status wird auch für alle anderen Transaktionen empfohlen.</i></p>
Transaktionskennung (Unique Transaction Identifier; UTI)	<p>Diese Variable enthält den UTI, bei dem es sich um eine eindeutige Identifikationskennung einer Transaktion handelt.</p> <p>Zu melden, wenn UTI zum Zeitpunkt der Meldungseinreichung verfügbar ist.</p>

Variable	Beschreibung
Interne Transaktionskennung (Proprietary Transaction Identification; PTI)	Der PTI ist eine eindeutige interne Transaktionskennung des Berichtspflichtigen, welche für jede Transaktion zu melden ist und pro Berichtspflichtigen sowie pro Marktsegment einmalig sein muss.
Zugehörige interne Transaktionskennung (Related Proprietary Transaction Identification)	Die zugehörige interne Transaktionskennung ist die PTI der ursprünglichen Transaktion, die durch eine Novation ersetzt wurde. <i>Liegt eine Novation vor, ist dieses Feld ein Pflichtfeld.</i>
PTI der Gegenpartei (Counterparty Proprietary Transaction Identification)	Diese Variable enthält den individuellen PTI der Gegenpartei der betroffenen Transaktion. <i>Nur bei Verfügbarkeit zu melden.</i>
Gegenpartei (Counterparty Identification)	Diese Variable enthält den LEI der Gegenpartei des Berichtspflichtigen. Dieses Feld ist ein Pflichtfeld für alle Gegenparteien, die einen LEI besitzen. Handelt es sich bei der Gegenpartei um eine Zweigniederlassung ohne eigenen LEI, ist der LEI der Muttergesellschaft zu melden. Wird die Transaktion über eine zentrale Gegenpartei (central clearing counterparty; CCP) abgeschlossen, ist ebenfalls der LEI der CCP zu melden. <i>Wenn die Gegenpartei keinen LEI besitzt, darf dieses Feld nicht im XML-Schema enthalten sein. Stattdessen werden die Felder „Sektor der Gegenpartei (Counterparty Sector)“ und „Sitzland der Gegenpartei (Counterparty Location)“ gemeldet.</i> Diese Variable ist als „LEI“ in der MMSR message bezeichnet und befindet sich im Block „CounterpartyIdentification“.
Sektor der Gegenpartei (Counterparty Sector)	Mit dieser Variablen wird der Sektor der Gegenpartei, z. B. nichtfinanzielle Kapitalgesellschaft etc., angegeben. <i>Der Sektor der Gegenpartei (Counterparty Sector) muss für alle Transaktionen gemeldet werden, bei der das Feld „Gegenpartei (Counterparty Identification)“ nicht gemeldet werden kann.</i> Diese Variable ist als „Sector“ in der MMSR message bezeichnet und befindet sich unter „SectorAndLocation“ im Block „CounterpartyIdentification“.

Variable	Beschreibung
Sitzland der Gegenpartei (Counterparty Location)	<p>Hier wird der ISO Ländercode des Landes gemeldet, in dem der Geschäftspartner seinen Sitz hat.</p> <p><i>Das „Sitzland der Gegenpartei (Counterparty Location)“ muss für alle Transaktionen gemeldet werden, bei der das Feld „Gegenpartei (Counterparty Identification)“ gemeldet werden kann.</i></p> <p>Diese Variable ist als „Location“ in der MMSR message bezeichnet und befindet sich unter „SectorAndLocation“ im Block „CounterpartyIdentification“.</p>
Handelstag (Trade Date)	<p>Beim Handelstag handelt es sich um den Tag und die Uhrzeit an denen die Transaktion vereinbart wird. Sollte die Uhrzeit der Transaktion nicht bekannt sein, ist lediglich das Datum zu melden.</p> <p>Die zu meldende Uhrzeit ist – soweit verfügbar – die Ausführungs- oder anderweitig die Buchungszeit der Transaktion. Als Zeitinformation muss ein realer Zeitpunkt angegeben werden. Die Meldung eines Standardwerts (z.B. Mitternacht) ist nicht zulässig.</p> <p>Der Handelstag muss immer vor oder am Abwicklungstag liegen. Ausnahmen stellen Novations sowie Fälle, in denen die Gegenparteien eine vor dem Handelstag beginnende Zinszahlung vereinbart haben, dar. In diesen Fällen kann der Handelstag nach dem Abwicklungstag liegen.</p>
Starttag (Start Date)	Der Starttag bezeichnet den ersten Tag, an dem der Tagesgeldsatz des periodisch variablen Zinssatzes berechnet wird.
Fälligkeitstag (Maturity Date)	Der Fälligkeitstag bezeichnet den letzten Tag des Zeitraums, über den der zusammengesetzte Tagesgeldsatz berechnet wird.
Festzinssatz (Fixed Interest Rate)	Diese Variable enthält den verwendeten Festzinssatz des Overnight Index Swaps. Der Wert kann je nach Vereinbarung entweder positiv oder negativ sein – unabhängig vom Transaktionsvorzeichen.
Art der Transaktion (OIS Transaction Type)	<p>Die Art der Transaktion dient dazu, anzugeben, ob der Festzinsatz vom Berichtspflichtigen gezahlt oder empfangen wird.</p> <p>Diese Variable ist als „TransactionType“ in der MMSR message bezeichnet.</p>
Nennwert der Transaktion (Transaction Nominal Amount)	<p>Diese Variable enthält den Nennwert des Overnight Index Swaps.</p> <p>In der MMSR message muss gekennzeichnet werden, dass es sich bei der Währung um Euro handelt.</p>

Anhang 1: Codelisten

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

Name der Codeliste	Inhalt	Beschreibung
	S122	Kreditinstitute, ohne die Zentralbank
	S123	Geldmarktfonds
	S124	Investmentfonds, ohne Geldmarktfonds
	S125	sonstige Finanzinstitute, ohne Versicherungsgesellschaften und Altersvorsorgeeinrichtungen
	S126	Kredit- und Versicherungshilfstätigkeiten
	S127	Firmeneigene Finanzierungseinrichtungen und Kapitalgeber
	S128	Versicherungsgesellschaften
	S129	Altersvorsorgeeinrichtungen
	S13	Staat
CL_COUNTRY	Siehe ISO 3166-1 alpha-2	
CL_DATASETACTION	NOTX	Fehlanzeige (No transaction)
CL_FX_TRANSACTION_TYPE	BUYI	Nennwert der Transaktion wird am Tag der Valuta gekauft.
	SELL	Nennwert der Transaktion wird am Tag der Valuta verkauft.
CL_INSTRUMENT_TYPE	DPST	Einlage (Deposit)
	CACM	Tagesgeld (Call account/call money)
	CEOD	Einlagenzertifikat (Certificate of deposit)
	COPR	Commercial paper
	ABCP	Asset backed commercial paper
	FRNT	Variabel verzinsliche Schuldverschreibung (Floating rate note)
	OTHR	Sonstige kurzfristige Schuldverschreibungen (Other short-term debt securities issued)
CL_MARKET_SEGMENT	auth.012.001.02	Besicherte Geldmarkttransaktionen
	auth.013.001.02	Unbesicherte Geldmarkttransaktionen

Name der Codeliste	Inhalt	Beschreibung
	auth.014.001.02	Devisenswapgeschäfte
	auth.015.001.02	Overnight Index Swaps
CL_NOVATION_STATUS	NONO	Transaktion ist keine Novation.
	NOVA	Transaktion ist eine Novation.
CL_OIS_TRANSACTION_TYPE	PAID	Der fixe Zinssatz wird vom berichtspflichtigen Institut gezahlt.
	RECE	Das berichtspflichtige Institut erhält den fixen Zinssatz.
CL_RATE_TYPE	FIXE	Fixer Zinssatz
	VARI	Variabler Zinssatz
CL_REPORTED_TRANSACTION_STATUS	AMND	Korrektur/Ergänzung (Amendment)
	CANC	Löschung (Cancellation)
	CORR	Korrektur (Correction)
	NEWT	Neue Transaktion (New transaction)
CL_SPECIAL_COLLATERAL_INDICATOR	GENE	Allgemeine Sicherheit (General collateral)
	SPEC	Spezielle Sicherheit (Special collateral)
	MRRP	Wertpapierleihe
CL_TRANSACTION_TYPE	BORR	Geldaufnahme (Borrowing)
	LEND	Geldvergabe (Lending)

Anhang 2: Plausibilitätsprüfungen

Die eingereichten XML-files werden durch die Deutsche Bundesbank überprüft. Ziel dieser Plausibilitätsprüfungen ist es, die eingereichten Meldungen auf ihre Korrektheit zu untersuchen. Die automatisierten Prüfungen sind im Internet veröffentlicht.

In den Dokumenten sind zu jeder Plausibilitätsprüfung **vier verschiedene Attribute** enthalten:

1) Der **Checkname** dient der Identifikation der Prüfung. Er setzt sich wie folgt zusammen:

- Alle Checknamen beginnen mit den Buchstaben „DQ“ bzw. „ADQ“
- Dieser Buchstabenkombination folgt ein weiterer Buchstabe, welcher sich am Marktsegment orientiert (z. B. „U“ für den unbesicherten Geldmarkt, „S“ für den besicherten Geldmarkt, „F“ für FX Swaps und „O“ für OIS) sowie zwei weitere Ziffern, welche die zu prüfende Variablennummer im entsprechenden Segment enthält („10“, „20“).
- Schließlich wird eine fortlaufende Nummer für jede Plausibilitätsprüfung vergeben, welche mit „0“ beginnt.

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

2) Die **Definition der Plausibilitätsprüfung** beschreibt in Worten den Fehler bzw. den Warnhinweis.

3) Die **Fehlerschwere** zeigt, welchen Einfluss der Fehler auf die gesamte Meldung hat. Dieses Attribut sagt auch aus, wie eine Transaktion im weiteren Verlauf behandelt wird:

- Ein Fehler (Error) führt zum Abweisen der Transaktion. Die Transaktion wird in der Datenbank gespeichert, eine Korrektur ist jedoch zwingend erforderlich. Eine Ausnahme stellen die Header-Checks dar. Bei diesen werden die Meldungen abgewiesen und es werden keine Transaktionen in der Datenbank gespeichert.
- Ein Warnhinweis (Warning) wird erzeugt, um das berichtspflichtige Institut zu einer erneuten Prüfung der Meldung bzw. Transaktion aufzufordern und ggf. eine Korrekturmeldung einzureichen. Die Meldung bzw. Transaktion wird jedoch in der Datenbank gespeichert;

- „No action“ sagt aus, dass die Plausibilitätsprüfung derzeit nicht durchgeführt wird.

4) Die **Konsequenz** aus einer Plausibilitätsprüfung wird in der letzten Spalte dargestellt, z. B. „Meldung bzw. Transaktion wird abgewiesen“.

Grundsätzlich können weitere Plausibilitätsprüfungen durchgeführt werden, um die Konsistenz der eingereichten Meldungen zu überprüfen. Aus diesem Grund können berichtspflichtige Institute auch bei technisch valider Meldungseinreichung kontaktiert werden und von der Deutschen Bundesbank vertiefende Nachfragen zu durchgeführten Transaktionen erhalten.

Anhang 3: Liste der ISINs möglicher Referenzzinssätze

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

In folgender Liste sind die ISIN-Codes für verschiedene Referenzzinssätze aufgeführt¹⁵:

Referenzzinssatz	ISIN
Euro short-term rate	EU000A2X2A25
Compounded euro short-term rate average rate, 1 week tenor	EU000A2QQF16
Compounded euro short-term rate average rate, 1 month tenor	EU000A2QQF24
Compounded euro short-term rate average rate, 3 month tenor	EU000A2QQF32
Compounded euro short-term rate average rate, 6 month tenor	EU000A2QQF40
Compounded euro short-term rate average rate, 12 month tenor	EU000A2QQF57
Over Night EONIA	EU0009659945
1 week EURIBOR	EU0009678507
1 month EURIBOR	EU0009659937
3 month EURIBOR	EU0009652783
6 month EURIBOR	EU0009652791
12 month EURIBOR	EU0009652809
Overnight LIBOR	EU0000000999
1 week LIBOR	GB00BBD82B22
1 month LIBOR	GB0004356027
2 month LIBOR	GB00BBD82C39
3 month LIBOR	GB0004356795
6 month LIBOR	GB0004357090
12 month LIBOR	GB0004359369
ECB MRO Rate (fixed rate tenders fixed rate)	EU0000000009
ECB MRO Rate (variable rate tenders minimum bid rate)	EU0000000008
ECB Deposit Facility Rate	EU0000000007
ECB Marginal Lending Facility Rate	EU0000000006
Euro Overnight Index Swap 1-week (€STR)	EU0000000958
Euro Overnight Index Swap 1-year (€STR)	EU0000000957

¹⁵ Der Großteil dieser ISIN-Codes wurde künstlich erstellt, um sie im Rahmen der Geldmarktstatistik berichtsfähig zu machen. Insofern sind diese nicht als marktüblich anzusehen.

Referenzzinssatz	ISIN
Euro Overnight Index Swap 1-week (EONIA)	EU0000000998
Euro Overnight Index Swap 2-week (EONIA)	EU0000000997
Euro Overnight Index Swap 3-week (EONIA)	EU0000000996
Euro Overnight Index Swap 1-month (EONIA)	EU0000000995
Euro Overnight Index Swap 2-month (EONIA)	EU0000000994
Euro Overnight Index Swap 3-month (EONIA)	EU0000000993
Euro Overnight Index Swap 4-month (EONIA)	EU0000000992
Euro Overnight Index Swap 5-month (EONIA)	EU0000000991
Euro Overnight Index Swap 6-month (EONIA)	EU0000000990
Euro Overnight Index Swap 7-month (EONIA)	EU0000000989
Euro Overnight Index Swap 8-month (EONIA)	EU0000000988
Euro Overnight Index Swap 9-month (EONIA)	EU0000000987
Euro Overnight Index Swap 10-month (EONIA)	EU0000000986
Euro Overnight Index Swap 11-month (EONIA)	EU0000000985
Euro Overnight Index Swap 1-year (EONIA)	EU0000000984
Euro Overnight Index Swap 13-month (EONIA)	EU0000000983
Euro Overnight Index Swap 14-month (EONIA)	EU0000000982
Euro Overnight Index Swap 15-month (EONIA)	EU0000000981
Euro Overnight Index Swap 16-month (EONIA)	EU0000000980
Euro Overnight Index Swap 17-month (EONIA)	EU0000000979
Euro Overnight Index Swap 18-month (EONIA)	EU0000000978
Euro Overnight Index Swap 19-month (EONIA)	EU0000000977
Euro Overnight Index Swap 20-month (EONIA)	EU0000000976
Euro Overnight Index Swap 21-month (EONIA)	EU0000000975
Euro Overnight Index Swap 22-month (EONIA)	EU0000000974
Euro Overnight Index Swap 23-month (EONIA)	EU0000000973
Euro Overnight Index Swap 2-year (EONIA)	EU0000000972
Euro Overnight Index Swap 30-month (EONIA)	EU0000000971
Euro Overnight Index Swap 3-year (EONIA)	EU0000000970
Euro Overnight Index Swap 4-year (EONIA)	EU0000000969
Euro Overnight Index Swap 5-year (EONIA)	EU0000000968
Euro Overnight Index Swap 6-year (EONIA)	EU0000000967
Euro Overnight Index Swap 7-year (EONIA)	EU0000000966
Euro Overnight Index Swap 8-year (EONIA)	EU0000000965
Euro Overnight Index Swap 9-year (EONIA)	EU0000000964
Euro Overnight Index Swap 10-year (EONIA)	EU0000000963

Referenzzinssatz	ISIN
Euro Overnight Index Swap 12-year (EONIA)	EU0000000962
Euro Overnight Index Swap 15-year (EONIA)	EU0000000961
Euro Overnight Index Swap 20-year (EONIA)	EU0000000960
Euro Overnight Index Swap 30-year (EONIA)	EU0000000959

Anhang 4: Liste supranationaler Organisationen

Wird eine Transaktion mit einer supranationalen Organisation als Gegenpartei getätigt, muss diese Gegenpartei über den jeweiligen LEI identifiziert werden.

Die folgende Liste zeigt eine Auswahl an supranationalen Organisationen, die im Rahmen der Berichterstattung als Gegenpartei mit LEI zu melden sind. Sollte das meldepflichtige Institut eine supranationale Organisation als Gegenpartei identifizieren, welche sich nicht in der Liste befindet, so ist diese ebenfalls mit LEI auszuweisen.

Name of the supranational authority	LEI code
African Development Bank (AfDB)	549300LNCLMO3ITVCU07
African Export-Import Bank	21380068LJCDYA42GJ76
Andean Development Corporation – Development Bank of Latin America	UKZ46SXGNYCZK0UOZE76
Arab Bank for Economic Development in Africa (BADEA)	549300BZGC73FHYP9S05
Arab Fund For Economic & Social Development (AFESD)	549300O4QHK2ENLCGV47
Arab Monetary Fund (AMF)	549300WT3YR8YON1F749
Asian Development Bank (AsDB)	549300X0MVH42CY8Q105
Bank for International Settlements (BIS)	UXIATLMNPCXXT5KR1S08
Black Sea Trade and Development Bank (BSTDB)	529900J7FSFACAGZ5042
Caribbean Development Bank (CDB)	549300TSCH0ZTLR5W421
Central American Bank for Economic Integration (CABEI)	549300OLDAMXBPSHC05
Council of Europe Development Bank (CEB)	549300UYNXMI821WYG82
Eastern Caribbean Central Bank (ECCB)	549300JQ26UYI7I7C72
Eurasian Development Bank (EDB) / Евразийский банк развития	253400Q2AQ3F58BLL187
European Bank for Reconstruction and Development (EBRD)	549300HTGDOVDU6OGK19
European Central Bank (ECB)	549300DTUYXVMJXZNY75
European Company for the Financing of Railroad Rolling Stock (EUROFIMA)	4S66HJ5RNB5ZWG9YW219
European Investment Bank (EIB)	5493006YXS1U5GIHE750
European Stability Mechanism (ESM)	222100W4EEAQ77386N50
Foreign Trade Bank of Latin America / Banco Latinoamericano de Comercio Exterior – Bladex	549300CN3134K4LC0651
Inter-American Development Bank (IDB)	VKU1UKDS9E7LYLMACP54
International Bank for Economic Cooperation (IBEC)	253400HA8YB1HUTNC692
International Bank for Reconstruction and Development (IBRD)	ZTMSNXROF84AHWJNKQ93
International Development Association (IDA)	P41R60HC414IWQA1XW02
International Finance Corporation (IFC)	QKL54NQY28TCDAI75F60
International Finance Facility for Immunisation (IFFIm)	549300ILK2NRULX3HX87
International Fund for Agricultural Development (IFAD)	54930018GXVZ0BEQ7K32
International Investment Bank (IIB) / Международный инвестиционный банк	2534000PHLD27VN98Y03
International Monetary Fund (IMF)	E7EXN6FJGRUTJYNZ3Z71
Latin American Reserve Fund / Fondo Latinoamericano de Reservas (FLAR)	5493004ND385U1DPOZ64

Name of the supranational authority	LEI code
Multilateral Investment Guarantee Agency (MIGA)	549300ZG5PH6MA164968
Nordic Development Fund (NDF)	213800UECLFCLO57RQ80
Nordic Investment Bank (NIB)	213800HYL1S7VAXG6Z48
North American Development Bank (NADB)	5493008W785ZKQMVNG08
OPEC Fund for International Development (OPEC Fund)	HHX3T53LK1P186EUNV37

Anhang 5: Liste der Multiplikatoren zur Berechnung der FX Forward Points

Die Berechnung der FX Forward Points ist abhängig von dem Devisenkassa- und Devisenforwardkurs sowie von dem für die Währung anzuwendenden Multiplikator.

Folgende Tabelle enthält den Multiplikator je Währung, der zur Berechnung der FX Forward Points herangezogen werden muss.

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

Zentralbereich Statistik
Geldmarktstatistik-Hotline: 069 9566-37630