

6/1/14. DVO hypKapital

ANHANG I

ANHANG I

ANHANG I

Angaben zum hypothetischen Kapital

ID	Posten	Verweise auf die Rechtsgrundla- ge	Betrag
10	Zentrale Gegenpartei	–	
20	Ausfallfonds-Kennung	Artikel 50c Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012	
30	Berechnungsdatum	Artikel 1 Absatz 2 der Durchführungsverordnung (EU) Nr. 484/2014 der Kommission	
40	Hypothetisches Kapital (K_{CCP})	Artikel 50c Absatz 1 Buchstabe a der Verordnung (EU) Nr. 648/2012	
50	Summe der vorfinanzierten Beiträge (DF_{CM})	Artikel 50c Absatz 1 Buchstabe b der Verordnung (EU) Nr. 648/2012	
60	Betrag der vorfinanzierten finanziellen Mittel, die sie einsetzen muss, bevor sie die Ausfallfondsbeiträge der übrigen Clearingmitglieder (DF_{CCP}) verwenden darf	Artikel 50c Absatz 1 Buchstabe c der Verordnung (EU) Nr. 648/2012	
70	Gesamtzahl der Clearingmitglieder (N)	Artikel 50c Absatz 1 Buchstabe d der Verordnung (EU) Nr. 648/2012	
80	Konzentrationsfaktor (β)	Artikel 50c Absatz 1 Buchstabe e der Verordnung (EU) Nr. 648/2012	
90	Gesamtbetrag der Einschusszahlungen	Artikel 89 Absatz 5a Unterabsatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012	

EMIR-VO
+ Ven
SFT-VO
SFT-VollzugsG
ZGVG + ZG-EKV

6/1/14. DVO hypKapital

ANHANG II

ANHANG II

ANHANG II

HINWEISE ZUR MELDUNG DER ANGABEN ZUM HYPOTHETISCHEN KAPITAL

1. Dieser Anhang enthält zusätzliche Hinweise zu der in Anhang I aufgeführten Tabelle.
ALLGEMEINE HINWEISE
2. Häufigkeit
- 2.1. Die Meldungen sind in den in Artikel 1 dieser Durchführungsverordnung festgelegten Zeitabständen zu übermitteln.
3. Einreichungstermine
- 3.1. Die Einreichungstermine werden in Artikel 2 aufgeführt.
HINWEISE ZU DEN BÖGEN
4. Vorzeichenkonvention
- 4.1. Sämtliche Beträge sind als positive Werte auszuweisen.
- 4.2. Beim Ausfüllen der Bögen sind die folgenden Formate und Verweise auf Rechtsgrundlagen zu berücksichtigen:

ID des Bogens	Hinweise	
10	Name der zentralen Gegenpartei (ZGP)	
	Format	Text, beliebige Anzahl von Buchstaben
20	Ausfallfonds-Kennung	
	Rechtsgrundlage	Artikel 50c Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012
	Hinweis	Gemäß Artikel 50c Absatz 1 liefert die ZGP, wenn sie mehr als einen Ausfallfonds hat, die Angaben nach Unterabsatz 1 des genannten Artikels für jeden Fonds getrennt.
	Format	Text, beliebige Anzahl von Buchstaben
	Berechnung	Keine
30	Berechnungsdatum	
	Rechtsgrundlage	Artikel 1 Absatz 2 dieser Durchführungsverordnung
	Bemerkung	Das Berechnungsdatum gemäß Artikel 1 Absatz 2 dieser Durchführungsverordnung, je nach vorgeschriebener Häufigkeit.
	Format	JJJJ-MM-TT Vierstellige Jahresangabe, Bindestrich, zweistellige Monatsangabe, Bindestrich, zweistellige Tagesangabe
	Berechnung	Keine
40	Hypothetisches Kapital (K_{CCP})	
	Rechtsgrundlage	Artikel 50c Absatz 1 Buchstabe a der Verordnung (EU) Nr. 648/2012
	Hinweise	Die Berichtswährung wird nach ISO 4217 ermittelt; dem Währungskürzel folgen ein Leerzeichen und der Betrag. Zahlen können mit einem Rundungsfehler von weniger als 1 % gerundet werden.
	Format	ISO-Währungskürzel Betrag
	Berechnung	Das hypothetische Kapital wird nach Artikel 50a Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 berechnet.
50	Summe der vorfinanzierten Beiträge (DF_{CM})	
	Rechtsgrundlage	Artikel 50c Absatz 1 Buchstabe b der Verordnung (EU) Nr. 648/2012.

6/1/14. DVO hypKapital
ANHANG II

ID des Bogens	Hinweise	
	Berechnung	Die vorfinanzierten Beiträge werden gemäß Artikel 308 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 als Summe der vorfinanzierten Beiträge der Clearingmitglieder berechnet.
	Hinweise	Die Berichtswährung wird nach ISO 4217 ermittelt; dem Währungskürzel folgen ein Leerzeichen und der Betrag. Zahlen können mit einem Rundungsfehler von weniger als 1 % gerundet werden.
	Format	ISO-Währungskürzel Betrag
60	Betrag der vorfinanzierten finanziellen Mittel, die sie einsetzen muss, bevor sie die Ausfallfondsbeiträge der übrigen Clearingmitglieder (DF_{CCP}) verwenden darf	
	Rechtsgrundlage	Artikel 50c Absatz 1 Buchstabe c der Verordnung (EU) Nr. 648/2012
	Berechnung	Die Summe der vorfinanzierten Beiträge aller Clearingmitglieder der zentralen Gegenpartei wird nach Artikel 308 Absatz 3 Buchstabe c der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 berechnet.
	Hinweise	Die Berichtswährung wird nach ISO 4217 ermittelt; dem Währungskürzel folgen ein Leerzeichen und der Betrag. Zahlen können mit einem Rundungsfehler von weniger als 1 % gerundet werden.
	Format	ISO-Währungskürzel Betrag
70	Die Gesamtzahl der Clearingmitglieder (N)	
	Rechtsgrundlage	Artikel 50c Absatz 1 Buchstabe d der Verordnung (EU) Nr. 648/2012
	Berechnung	Die Anzahl der Clearingmitglieder der zentralen Gegenpartei
	Format	Ganze Zahl
80	Konzentrationsfaktor (β)	
	Rechtsgrundlage	Artikel 50c Absatz 1 Buchstabe e der Verordnung (EU) Nr. 648/2012
	Berechnung	Der Konzentrationsfaktor wird nach Artikel 50d Buchstabe c der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 berechnet.
	Hinweise	Die Berichtswährung wird nach ISO 4217 ermittelt; dem Währungskürzel folgen ein Leerzeichen und der Betrag. Zahlen können mit einem Rundungsfehler von weniger als 1 % gerundet werden.
	Format	ISO-Währungskürzel Betrag
90	Gesamtbetrag der Einschusszahlungen	
	Rechtsgrundlage	Artikel 89 Absatz 5a Unterabsatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012
	Berechnung	Die Summe der Einschusszahlungen, die die zentrale Gegenpartei von ihren Clearingmitgliedern erhielt, wird nach den Artikeln 24 bis 27 der delegierten Verordnung (EU) Nr. 153/2013 berechnet.
	Hinweise	Diese Angabe wird nur gemacht, wo dies zutrifft. Die Berichtswährung wird nach ISO 4217 ermittelt; dem Währungskürzel folgen ein Leerzeichen und der Betrag. Zahlen können mit einem Rundungsfehler von weniger als 1 % gerundet werden.
	Format	ISO-Währungskürzel Betrag

EMIR-VO
 + Ven
SFT-VO
 SFT-VollzugsG
 ZGVG + ZG-EKV