

1/4/26. DfVO Berichte von WP
ANHANG I

ANHANG I

ANHANG I

Format der wöchentlichen Berichte

Tabella 1
Wöchentliche Berichte

{Name des Handelsplatzes} {Kennung des Handelsplatzes} {Bezugsdatum des wöchentlichen Berichts} {Datum und Uhrzeit der Veröffentlichung} {Bezeichnung des Warenderivatkontrakts, des Emissionszertifikats oder des Derivats davon} {Produktcode des Handelsplatzes} {Berichtsstatus}											
	Angabe der Größe der Position		Wertpapierfirmen oder Kreditinstitute		Investitionsfonds		Sonstige Finanzinstitute		Gewerbliche Unternehmen		Betreiber mit Verpflichtung zur Einhaltung der Anforderungen der Richtlinie 2003/87/EG
			Kaufposition	Verkaufsposition	Kaufposition	Verkaufsposition	Kaufposition	Verkaufsposition	Kaufposition	Verkaufsposition	
Anzahl der Positionen		Verringerung von direkt mit der Geschäftstätigkeit verbundenen Risiken									
		Sonstige									
		Insgesamt									
Veränderungen seit dem letzten Bericht (±)		Verringerung von direkt mit der Geschäftstätigkeit verbundenen Risiken									
		Sonstige									

1/4/26. DfVO Berichte von WP
ANHANG I

		Insgesamt										
Prozentsatz der gesamten offenen Kontraktpositionen		Verringerung von direkt mit der Geschäftstätigkeit verbundenen Risiken										
		Sonstige										
		Insgesamt										
Anzahl der Personen, die in den einzelnen Kategorien Positionen halten			Kombiniert	Kombiniert	Kombiniert	Kombiniert	Kombiniert	Kombiniert				
		Insgesamt										

Tabelle 2
Legende zu Tabelle 3

ZEICHEN	DATENTYP	DEFINITION
{ALPHANUM-n}	Bis zu n alphanumerische Zeichen	Freitextfeld.
{DECIMAL-n/m}	Dezimalzahl mit bis zu n Stellen insgesamt, wovon bis zu m Stellen Nachkommastellen sein können	Numerisches Feld für positive und negative Werte: – Dezimalzeichen ist ein Punkt (.); – negativen Zahlen wird ein Minuszeichen (-) vorangestellt; Werte werden gegebenenfalls gerundet und nicht gekürzt.
{DATEFORMAT}	Datumsformat nach ISO 8601	Das Datum ist in folgendem Format anzugeben: JJJJ-MM-TT.
{DATE_TIME_FORMAT}	Datums- und Zeitformat nach ISO 8601	– Datum und Uhrzeit in folgendem Format: JJJJ-MM-TTThh:mm:ss.ffffffZ. – „JJJJ“ bezeichnet das Jahr. – „MM“ bezeichnet den Monat. – „TT“ bezeichnet den Tag. – „T“ bedeutet, dass der Buchstabe „T“ verwendet werden soll. – „hh“ bezeichnet die Stunde. – „mm“ bezeichnet die Minute. – „ss.ffffff“ bezeichnet die Sekunde und den Bruchteil einer Sekunde. – Z bezeichnet die UTC-Zeit (koordinierte Weltzeit).

1/4/26. DfVO Berichte von WP
ANHANG I

ZEICHEN	DATENTYP	DEFINITION
		Datum und Uhrzeit sind als UTC-Zeit anzugeben.
{MIC}	4 alphanumerische Zeichen	Marktidentifikationscode (MIC) gemäß ISO 10383.
{INTEGER-n}	Ganze Zahl mit bis zu n Ziffern insgesamt.	Numerisches Feld für positive und negative ganzzahlige Werte.

Tabelle 3

Tabelle der für jedes Warenderivat, Emissionszertifikat oder Derivat für die Zwecke des Artikels 1 auszufüllenden Felder

FELD	ZU MELDENDE ANGABEN	BERICHTSFORMAT
Name des Handelsplatzes	Vollständiger Name des Handelsplatzes.	{ALPHANUM-350}
Kennung des Handelsplatzes	Segment-MIC des Handelsplatzes nach ISO 10383. Ist kein Segment-MIC verfügbar, ist der Operating-MIC zu verwenden.	{MIC}
Bezugsdatum des wöchentlichen Berichts	Datum des Freitags der Kalenderwoche, an dem die Position gehalten wird.	{DATEFORMAT}
Datum und Uhrzeit der Veröffentlichung	Datum und Uhrzeit der Veröffentlichung des Berichts auf der Website des Handelsplatzes.	{DATE_TIME_FORMAT}
Bezeichnung des Warenderivatkontrakts, des Emissionszertifikats oder des Derivats davon	Bezeichnung des Warenderivatkontrakts, des Emissionszertifikats oder des Derivats davon anhand des Produktcodes des Handelsplatzes.	{ALPHANUM-350}
Produktcode des Handelsplatzes	Einheitliche und eindeutige alphanumerische Kennung, die der Handelsplatz bei Gruppierung von Kontrakten im gleichen Produkt, aber mit unterschiedlichen Fälligkeiten und unterschiedlichem Ausübungspreis verwendet.	{ALPHANUM-12}
Berichtsstatus	Angabe, ob es sich um einen neuen Bericht oder um Stornierung oder Änderung eines früheren Berichts handelt. Wird ein früher eingereichter Bericht storniert oder geändert, sollte ein Bericht mit allen Einzelheiten des ursprünglichen Berichts übermittelt und als Berichtsstatus „CANC“ angegeben werden. Bei Änderungen sollte ein neuer Bericht mit allen Einzelheiten des ursprünglichen Berichts und allen erforderlichen Angaben zu den vorgenommenen Änderungen übermittelt und als Berichtsstatus „AMND“ angegeben werden.	„NEWT“ – Neu „CANC“ – Stornierung „AMND“ – Änderung
Anzahl der Positionen	Aggregierte Größe der offenen Kontraktpositionen, die am Freitag am Ende des Handelstages gehalten werden. Die Größe sollte entweder als Anzahl der Lose (bei Angabe der Positionslimits in Losen) oder als Einheiten des Basiswerts ausgedrückt werden. Optionskontrakte fließen in die Aggregation ein und werden als Delta-Äquivalent gemeldet.	{DECIMAL-15/2}
Angabe der Größe der Position	Angabe der zur Meldung der Anzahl der Positionen verwendeten Einheiten.	„LOTS“ – bei Angabe der Größe der Position in Losen oder {ALPHANUM-25} – Beschreibung der verwendeten Einheiten bei

1/4/26. DfVO Berichte von WP

ANHANG II

FELD	ZU MELDENDE ANGABEN	BERICHTSFORMAT
		Angabe der Größe der Position in Einheiten des Basiswerts
Veränderungen seit dem letzten Bericht (±)	Größe der Position, der entnommen werden kann, ob im Vergleich zum vorhergehenden Freitag eine Vergrößerung oder Verkleinerung der Position eingetreten ist. Bei einer Verkleinerung der Position wird der Zahl ein Minuszeichen (-) vorangestellt.	{DECIMAL-15/2}
Prozentsatz der gesamten offenen Kontraktpositionen	Prozentsatz der gesamten offenen Kontraktpositionen.	{DECIMAL-5/2}
Anzahl der Personen, die eine Position in jeder Kategorie halten	Anzahl der Personen, die in der Kategorie eine Position halten. Liegt die Anzahl der Personen, die eine Position in der Kategorie halten, unter der im delegierten Rechtsakt der Kommission in Bezug auf Artikel 58 Absatz 6 von MiFID II ⁽¹⁾ festgelegten Anzahl, wird in diesem Feld ein Punkt (.) angegeben.	{INTEGER-7} oder {ALPHANUM-1} wenn im Feld ein Punkt (.) anzugeben ist.

⁽¹⁾ Delegierte Verordnung (EU) 2017/565 der Kommission vom 25. April 2016 zur Ergänzung der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates in Bezug auf die organisatorischen Anforderungen an Wertpapierfirmen und die Bedingungen für die Ausübung ihrer Tätigkeit sowie in Bezug auf die Definition bestimmter Begriffe für die Zwecke der genannten Richtlinie (ABl. L 87 vom 31.3.2017, S. 1).

ANHANG II

ANHANG II

Format der täglichen Berichte

Tabelle 1

Legende zu Tabelle 2

ZEICHEN	DATENTYP	DEFINITION
{ALPHANUM-n}	Bis zu n alphanumerische Zeichen	Freitextfeld.
{DECIMAL-n/m}	Dezimalzahl mit bis zu n Stellen insgesamt, wovon bis zu m Stellen Nachkommastellen sein können	Numerisches Feld für positive und negative Werte: – Dezimalzeichen ist ein Punkt (.); – negativen Zahlen wird ein Minuszeichen (-) vorangestellt; Werte werden gegebenenfalls gerundet und nicht gekürzt.
{DATEFORMAT}	Datumsformat nach ISO 8601	Das Datum ist in folgendem Format anzugeben: JJJJ-MM-TT.
{DATE_TIME_FORMAT}	Datums- und Zeitformat nach ISO 8601	– Datum und Uhrzeit in folgendem Format: J J J J - M M - T T - Thh:mm:ss.fffffZ.

1/4/26. DfVO Berichte von WP
ANHANG II

WAG 2018
HTAusV
QVV
MiFIR
MiFIR DfVO
MiFID II
MiFID DfVO

ZEICHEN	DATENTYP	DEFINITION
		<ul style="list-style-type: none"> – „JJJ” bezeichnet das Jahr. – „MM” bezeichnet den Monat. – „TT” bezeichnet den Tag. – „T” bedeutet, dass der Buchstabe „T” verwendet werden soll. – „hh” bezeichnet die Stunde. – „mm” bezeichnet die Minute. – „ss.ddddd” bezeichnet die Sekunde und den Bruchteil einer Sekunde. – Z bezeichnet die UTC-Zeit (koordinierte Weltzeit). <p>Datum und Uhrzeit sind als UTC-Zeit anzugeben.</p>
{ISIN}	12 alphanumerische Zeichen	ISIN-Code gemäß ISO 6166
{LEI}	20 alphanumerische Zeichen	Kennung für juristische Personen (Rechtsträgerkennung) gemäß ISO 17442
{MIC}	4 alphanumerische Zeichen	Marktidentifikationscode (MIC) gemäß ISO 10383.
{NATIONAL_ID}	35 alphanumerische Zeichen	Die ID ist die in Artikel 6 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/590 der Kommission ⁽¹⁾ über Meldepflichten gemäß Artikel 26 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽²⁾ und in Anhang II der genannten Verordnung festgelegte Kennung.
{INTEGER-n}	Ganze Zahl mit bis zu n Ziffern insgesamt.	Numerisches Feld für positive und negative ganzzahlige Werte.

⁽¹⁾ Delegierte Verordnung (EU) 2017/590 der Kommission vom 28. Juli 2016 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für die Meldung von Geschäften an die zuständigen Behörden (Text von Bedeutung für den EWR.) (ABl. L 87 vom 31.3.2017, S. 449).

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

1/4/26. DfVO Berichte von WP

ANHANG II

Tabelle 2

Tabelle der für alle Positionen für sämtliche Fälligkeiten aller Kontrakte für die Zwecke des Artikels 2 auszufüllenden Felder

FELD	ZU MELDENDE ANGABEN	BERICHTSFORMAT
Datum und Uhrzeit der Einreichung des Berichts	Datum und Uhrzeit der Einreichung des Berichts.	{DATE_TIME_FORMAT}
Referenznummer des Berichts	Vom Einreichenden zugeteilte eindeutige Kennung zur eindeutigen Zuordnung des Berichts zum Einreichenden und zur empfangenden zuständigen Behörde.	{ALPHANUM-52}
Datum des Handelstags der gemeldeten Position	Datum, an dem die gemeldete Position bei Geschäftsschluss am betreffenden Handelsplatz gehalten wird.	{DATEFORMAT}
Berichtsstatus	Angabe, ob es sich um einen neuen Bericht oder um Stornierung oder Änderung eines früher eingereichten Berichts handelt. Wird ein früher eingereichter Bericht storniert oder geändert, sollte ein Bericht mit allen Einzelheiten des ursprünglichen Berichts mit Angabe der ursprünglichen Referenznummer des Berichts übermittelt und als Berichtsstatus „CANC“ angegeben werden. Bei Änderungen sollte ein neuer Bericht mit allen Einzelheiten des ursprünglichen Berichts mit Angabe der ursprünglichen Referenznummer des Berichts und allen erforderlichen Angaben zu den vorgenommenen Änderungen übermittelt und als Berichtsstatus „AMND“ angegeben werden.	5,„NEWT“ – Neu „CANC“ – Stornierung „AMND“ – Änderung
Kennung der meldenden Stelle	Kennung der meldenden Wertpapierfirma. Kennung für juristische Personen (Rechtsträgerkennung – LEI) oder {NATIONAL_ID} für natürliche Personen, die keine LEI haben.	{LEI} oder {NATIONAL_ID} – Natürliche Personen
Kennung des Positionsinhabers	Kennung für juristische Personen (Rechtsträgerkennung – LEI) oder {NATIONAL_ID} für natürliche Personen, die keine LEI haben. (Hinweis: Wird die Position als Eigenhandelsposition des meldenden Unternehmens gehalten, so ist dieses Feld mit dem Feld „Kennung der meldenden Stelle“) identisch.	{LEI} oder {NATIONAL_ID} – Natürliche Personen
E-Mail-Adresse des Positionsinhabers	E-Mail-Adresse für positionsrelevante Benachrichtigungen.	{ALPHANUM-256}
Kennung des an der Spitze stehenden Mutterunternehmens	Kennung für juristische Personen (Rechtsträgerkennung – LEI) oder {NATIONAL_ID} für natürliche Personen, die keine LEI haben. Anmerkung: Dieses Feld kann mit dem Feld „Kennung der meldenden Stelle“ oder „Kennung des Positionsinhabers“ identisch sein, wenn das an der Spitze stehende Mutterunternehmen eigene Positionen hält oder eigene Berichte einreicht.	{LEI} oder {NATIONAL_ID} – Natürliche Personen
E-Mail-Adresse des an der Spitze stehenden Mutterunternehmens	E-Mail-Adresse für Schriftverkehr in Bezug auf aggregierte Positionen.	{ALPHANUM-256}
Mutterunternehmen mit dem Status eines Organismus	Angabe, ob der Positionsinhaber ein Organismus für gemeinsame Anlagen ist, der im Sinne von Artikel 4 Absatz 2 der Delegierten Verordnung	„TRUE“ – der Positionsinhaber ist ein Organismus für gemeinsame

1/4/26. DfVO Berichte von WP

ANHANG II

WAG 2018
HTAusV
QVV
MiFIR
MiFIR DfVO
MiFID II
MiFID DfVO

FELD	ZU MELDENDE ANGABEN	BERICHTSFORMAT
mus für gemeinsame Anlagen	nung (EU) 2017/591 der Kommission ⁽¹⁾ Investitionsentscheidungen unabhängig von seiner Muttergesellschaft trifft.	Anlagen, der unabhängige Investitionsentscheidungen trifft „FALSE“ – der Positionsinhaber ist kein Organismus für gemeinsame Anlagen, der unabhängige Investitionsentscheidungen trifft
Kennung des an Handelsplätzen gehandelten Kontrakts	Kennung des Warenderivats, Emissionszertifikats oder Derivats davon. Siehe Feld „Kennung des Handelsplatzes“ für die Behandlung von OTC-Kontrakten, die an Handelsplätzen gehandelten Kontrakten wirtschaftlich gleichwertig sind.	{ISIN}
Produktcode des Handelsplatzes	Angabe einer einheitlichen, eindeutigen alphanumerischen Kennung, die der Handelsplatz bei Gruppierung von Kontrakten im gleichen Produkt, aber mit unterschiedlichen Fälligkeiten und unterschiedlichem Ausübungspreis verwendet.	{ALPHANUM-12}
Kennung des Handelsplatzes	Segment-MIC nach ISO 10383 für Positionen in Bezug auf Kontrakte am Handelsplatz. Ist kein Segment-MIC verfügbar, ist der Operating-MIC zu verwenden. Verwendung des MIC-Codes „XXXX“ für Positionen in wirtschaftlich gleichwertigen OTC-Kontrakten außerhalb des Handelsplatzes. Verwendung des MIC-Codes „XOFF“ für außerbörslich gehandelte börsennotierte Derivate oder Emissionszertifikate.	{MIC}
Positionsart	Angabe, ob die Position in Terminkontrakten, Optionen, Emissionszertifikaten oder Derivaten davon, Warenderivaten im Sinne von Artikel 4 Absatz 1 Nummer 44 Buchstabe c der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽²⁾ oder in einer anderen Kontraktart eingegangen wurde.	„OPTN“ – Optionen, einschließlich getrennt handelbarer Optionen auf die Arten FUTR, SDRV oder OTHR, außer Produkten mit lediglich eingebetteter Optionaltät „FUTR“ – Terminkontrakte „EMIS“ – Emissionszertifikate und Derivate davon „SDRV“ – Warenderivate im Sinne von Artikel 4 Absatz 1 Nummer 44 Buchstabe c der Richtlinie 2014/65/EU „OTHR“ – alle sonstigen Kontraktarten
Fälligkeit der Position	Angabe, ob der Kontrakt, unter den die gemeldeten Positionen fallen, sich auf den Spot-Monat oder alle anderen Monate bezieht. Anmerkung: Für Spot-Monate und alle anderen Monate sind getrennte Berichte vorzulegen.	„SPOT“ – Spot-Monat, einschließlich aller Positionen in EMIS und SRDV „OTHR“ – alle anderen Monate

1/4/26. DfVO Berichte von WP
ANHANG II

FELD	ZU MELDENE ANGABEN	BERICHTSFORMAT
Größe der Position	Größe der Nettoposition im Warenderivat, Emissionszertifikat oder Derivaten davon, ausgedrückt als Lose, wenn die Positionslimits in Losen ausgedrückt werden, oder als Einheiten des Basiswerts. Angabe einer positiven Zahl für Kaufpositionen und einer negativen Zahl für Verkaufpositionen. Bei Positionen in Warenderivaten im Sinne von Artikel 4 Absatz 1 Nummer 44 Buchstabe c der Richtlinie 2014/65/EU ist in diesem Feld die Zahl der gehaltenen Einheiten anzugeben.	{DECIMAL-15/2}
Angabe der Größe der Position	Angabe der für die Meldung der Größe der Position verwendeten Einheiten.	„LOTS“ – bei Angabe der Größe der Position in Losen {ALPHANUM-25} – Beschreibung der verwendeten Einheiten bei Angabe der Größe der Position in Einheiten des Basiswerts „UNIT“ – bei Angabe der Größe der Position in Einheiten
Deltaäquivalent der Größe der Position	Bei der Positionsart „OPTN“ oder einer Option auf „EMIS“ ist in diesem Feld das Deltaäquivalent der Größe der im Feld „Größe der Position“ gemeldeten Position anzugeben. Angabe einer positiven Zahl für Call-Kauf und Put-Verkauf und einer negativen Zahl für Put-Kauf und Call-Verkauf.	{DECIMAL-15/2}
Indikator des risikomindernden Charakters der Position in Bezug auf mit der Geschäftstätigkeit verbundene Risiken	Angabe, ob die Position das Risiko im Sinne von Artikel 7 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/591 verringert.	„TRUE“ – Die Position verringert das Risiko. „FALSE“ – Die Position verringert das Risiko nicht.

(¹) Delegierte Verordnung (EU) 2017/591 der Kommission vom 1. Dezember 2016 zur Ergänzung der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für die Anwendung von Positionslimits für Warenderivate (ABl. L 87 vom 31.3.2017, S. 479).

(²) Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 15. Mai 2014 über Märkte für Finanzinstrumente sowie zur Änderung der Richtlinien 2002/92/EG und 2011/61/EU (ABl. L 173 vom 12.6.2014, S. 349).