

**DURCHFÜHRUNGSVERORDNUNG (EU) 2017/1093 DER KOMMISSION****vom 20. Juni 2017****zur Festlegung technischer Durchführungsstandards im Hinblick auf das Format der Positionsberichte von Wertpapierfirmen und Marktbetreibern****(Text von Bedeutung für den EWR)**

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 15. Mai 2014 über Märkte für Finanzinstrumente <sup>(1)</sup>, insbesondere auf Artikel 58 Absatz 5,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Das Format des wöchentlichen Berichts über aggregierte Positionen, die von den unterschiedlichen Personenkategorien in den verschiedenen an Handelsplätzen gehandelten Warenderivaten oder Emissionszertifikaten bzw. Derivaten davon gehalten werden, sollte es ermöglichen, Positionen, die objektiv messbar die unmittelbar mit einer Geschäftstätigkeit im Zusammenhang stehenden Risiken verringern, sowie andere Positionen und Gesamtpositionen zu identifizieren, um in Bezug auf die Unterscheidung zwischen finanziellen und nicht finanziellen Tätigkeiten im Zusammenhang mit solchen Warenderivaten, Emissionszertifikaten bzw. Derivaten davon Transparenz zu gewährleisten.
- (2) Das Format der täglichen Berichte mit einer vollständigen Aufschlüsselung der Positionen von Wertpapierfirmen und ihren Kunden in an Handelsplätzen gehandelten Warenderivaten oder Emissionszertifikaten bzw. Derivaten davon und in wirtschaftlich gleichwertigen außerbörslich gehandelten (OTC-) Kontrakten sollte so strukturiert sein, dass Positionslimits gemäß Artikel 57 der Richtlinie 2014/65/EU einfacher kontrolliert und angewandt werden können.
- (3) Positionen, die sich aus Kauf- und Verkaufsgeschäften mit unterschiedlichen Lieferterminen oder Waren oder aus anderen komplexen Strategien ergeben, sollten aufgeschlüsselt gemeldet werden, es sei denn, die Kombination von Produkten wird als ein einziges Finanzinstrument mit ISIN-Kennung gehandelt und die darin gehaltenen Positionen unterliegen einer bestimmten Obergrenze.
- (4) Um ihre Aufgaben wirkungsvoll und kohärent wahrnehmen zu können, sollten die zuständigen Behörden und die Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) über Daten verfügen, die einen Vergleich zwischen Wertpapierfirmen und Marktbetreibern, die einen Handelsplatz betreiben, möglich machen. Die Verwendung eines über die verschiedenen Finanzmarktinfrastrukturen hinweg einheitlichen Formats erleichtert dessen verstärkte Nutzung durch ein breites Spektrum von Marktteilnehmern, wodurch eine Standardisierung gefördert wird.
- (5) Zur Erleichterung einer durchgängig automatisierten Abwicklung und zur Senkung der Kosten für die Marktteilnehmer sollten alle Wertpapierfirmen und Marktbetreiber, die einen Handelsplatz betreiben, Standardformate verwenden.
- (6) Die neuen Rechtsvorschriften des Europäischen Parlaments und des Rates über Märkte für Finanzinstrumente, die in der Richtlinie 2014/65/EU und der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(2)</sup> festgelegt sind, gelten ab dem 3. Januar 2018. Um Kohärenz und Rechtssicherheit zu gewährleisten, sollte diese Verordnung ab demselben Zeitpunkt gelten.
- (7) Diese Verordnung stützt sich auf den Entwurf technischer Durchführungsstandards, den die ESMA der Kommission vorgelegt hat.
- (8) Die ESMA hat offene öffentliche Konsultationen zu dem Entwurf technischer Durchführungsstandards, auf den sich diese Verordnung stützt, durchgeführt, die damit verbundenen potenziellen Kosten und Nutzeffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(3)</sup> eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt —

<sup>(1)</sup> ABl. L 173 vom 12.6.2014, S. 84.

<sup>(2)</sup> 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).

<sup>(3)</sup> Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/77/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84).

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

*Artikel 1*

**Wöchentliche Berichte**

1. Wertpapierfirmen oder Marktbetreiber, die einen Handelsplatz betreiben, erstellen die in Artikel 58 Absatz 1 Buchstabe a der Richtlinie 2014/65/EU genannten wöchentlichen Berichte getrennt für jedes an diesem Handelsplatz gehandelte Warenderivat, Emissionszertifikat oder Derivat davon unter Verwendung des in den Tabellen des Anhangs I beschriebenen Formats.
2. Die in Absatz 1 genannten Berichte enthalten aggregierte Angaben zu allen Positionen, die von den unterschiedlichen Personen in jeder der in Tabelle 1 des Anhangs I genannten Kategorien in den einzelnen an diesem Handelsplatz gehandelten Warenderivaten, Emissionszertifikaten oder Derivaten davon gehalten werden.

*Artikel 2*

**Tägliche Berichte**

1. Die Wertpapierfirmen übermitteln den zuständigen Behörden die Aufschlüsselung ihrer in Artikel 58 Absatz 2 der Richtlinie 2014/65/EU genannten Positionen in Form eines täglichen Positionsberichts unter Verwendung des in den Tabellen des Anhangs II beschriebenen Formats.
2. Der in Absatz 1 genannte Bericht enthält die Positionen für sämtliche Fälligkeiten aller Kontrakte.

*Artikel 3*

**Berichtsformat**

Betreiber von Handelsplätzen und Wertpapierfirmen übermitteln die in den Artikeln 1 und 2 genannten Berichte in einem einheitlichen XML-Format.

*Artikel 4*

**Inkrafttreten**

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

Sie gilt ab dem 3. Januar 2018.

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

Brüssel, den 20. Juni 2017

*Für die Kommission*  
*Der Präsident*  
Jean-Claude JUNCKER



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:<br>— Dezimalzeichen ist ein Punkt (.);<br>— negativen Zahlen wird ein Minuszeichen (-) vorangestellt;<br>Werte werden gegebenenfalls gerundet und nicht gekürzt.   |
| {DATEFORMAT}       | Datumsformat nach ISO 8601  | Das Datum ist in folgendem Format anzugeben:<br>JJJJ-MM-TT.  |
| {DATE_TIME_FORMAT} | Datums- und Zeitformat nach ISO 8601  | — Datum und Uhrzeit in folgendem Format:<br>JJJJ-MM-TTTh:mm:ss.fffffZ.<br>— „JJJJ“ bezeichnet das Jahr.<br>— „MM“ bezeichnet den Monat.<br>— „TT“ bezeichnet den Tag.<br>— „T“ bedeutet, dass der Buchstabe „T“ verwendet werden soll.<br>— „hh“ bezeichnet die Stunde.<br>— „mm“ bezeichnet die Minute.<br>— „ss.ddd“ bezeichnet die Sekunde und den Bruchteil einer Sekunde.<br>— Z bezeichnet die UTC-Zeit (koordinierte Weltzeit).<br>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}          |

| FELD  | ZU MELDENDE ANGABEN  | BERICHTSFORMAT   |
|---|--|--|
| 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  | <p>Angabe, ob es sich um einen neuen Bericht oder um Stornierung oder Änderung eines früheren Berichts handelt.</p> <p>Wird ein früher eingereichter Bericht storniert oder geändert, sollte ein Bericht mit allen Einzelheiten des ursprünglichen Berichts übermittelt und als Berichtsstatus „CANC“ angegeben werden.</p> <p>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.</p> | <p>„NEWT“ — Neu</p> <p>„CANC“ — Stornierung</p> <p>„AMND“ — Änderung</p>   |
| Anzahl der Positionen   | <p>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.</p> <p>Optionskontrakte fließen in die Aggregation ein und werden als Delta-Äquivalent gemeldet.</p>   | {DECIMAL-15/2}   |
| Angabe der Größe der Position   | Angabe der zur Meldung der Anzahl der Positionen verwendeten Einheiten.  | <p>„LOTS“ — bei Angabe der Größe der Position in Losen</p> <p>oder</p> <p>{ALPHANUM-25} — Beschreibung der verwendeten Einheiten bei Angabe der Größe der Position in Einheiten des Basiswerts</p> |
| Veränderungen seit dem letzten Bericht (±)  | <p>Größe der Position, der entnommen werden kann, ob im Vergleich zum vorhergehenden Freitag eine Vergrößerung oder Verkleinerung der Position eingetreten ist.</p> <p>Bei einer Verkleinerung der Position wird der Zahl ein Minuszeichen (–) vorangestellt.</p>  | {DECIMAL-15/2}   |

| FELD   | ZU MELDENDE ANGABEN   | BERICHTSFORMAT  |
|--|---|---|
| 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.<br>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 <sup>(1)</sup> festgelegten Anzahl, wird in diesem Feld ein Punkt (.) angegeben. | {INTEGER-7}<br>oder<br>{ALPHANUM-1} wenn im Feld ein Punkt (.) anzugeben ist. |

<sup>(1)</sup> 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

**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:<br>— Dezimalzeichen ist ein Punkt (.);<br>— negativen Zahlen wird ein Minuszeichen (-) vorangestellt;<br>Werte werden gegebenenfalls gerundet und nicht gekürzt.  |
| {DATEFORMAT}       | Datumsformat nach ISO 8601  | Das Datum ist in folgendem Format anzugeben:<br>JJJJ-MM-TT.   |
| {DATE_TIME_FORMAT} | Datums- und Zeitformat nach ISO 8601  | — Datum und Uhrzeit in folgendem Format:<br>JJJJ-MM-TTThh:mm:ss.ffffffZ.<br>— „JJJJ“ bezeichnet das Jahr.<br>— „MM“ bezeichnet den Monat.<br>— „TT“ bezeichnet den Tag.<br>— „T“ bedeutet, dass der Buchstabe „T“ verwendet werden soll.<br>— „hh“ bezeichnet die Stunde.<br>— „mm“ bezeichnet die Minute.<br>— „ss.ffffff“ bezeichnet die Sekunde und den Bruchteil einer Sekunde.<br>— Z bezeichnet die UTC-Zeit (koordinierte Weltzeit).<br>Datum und Uhrzeit sind als UTC-Zeit anzugeben. |
| {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 <sup>(1)</sup> über Meldepflichten gemäß Artikel 26 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(2)</sup> und in Anhang II der genannten Verordnung festgelegte Kennung.  |

| ZEICHEN     | DATENTYP                                   | DEFINITION  |
|-------------|--|---|
| {INTEGER-n} | Ganze Zahl mit bis zu n Ziffern insgesamt. | Numerisches Feld für positive und negative ganzzahlige Werte. |

(<sup>1</sup>) 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).

(<sup>2</sup>) 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).

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.<br>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.<br>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. | „NEWT“ — Neu<br>„CANC“ — Stornierung<br>„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}<br>oder<br>{NATIONAL_ID} — Natürliche Personen      |



| FELD   | ZU MELDENDE ANGABEN  | BERICHTSFORMAT   |
|--|--|--|
| Kennung des Positionsinhabers  | Kennung für juristische Personen (Rechts-trägerkennung — 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}<br>oder<br>{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 (Rechts-trägerkennung — 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}<br>oder<br>{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 für gemeinsame Anlagen | Angabe, ob der Positionsinhaber ein Organismus für gemeinsame Anlagen ist, der im Sinne von Artikel 4 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/591 der Kommission <sup>(1)</sup> Investitionsentscheidungen unabhängig von seiner Muttergesellschaft trifft.  | „TRUE“ — der Positionsinhaber ist ein Organismus für gemeinsame Anlagen, der unabhängige Investitionsentscheidungen trifft<br>„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.  | {MIC}  |

| FELD                          | ZU MELDENE ANGABEN  | BERICHTSFORMAT   |
|-------------------------------|---|--|
|                               | <p>Verwendung des MIC-Codes „XXXX“ für Positionen in wirtschaftlich gleichwertigen OTC-Kontrakten außerhalb des Handelsplatzes.</p> <p>Verwendung des MIC-Codes „XOFF“ für außerbörslich gehandelte börsennotierte Derivate oder Emissionszertifikate.</p>  |  |
| Positionsart                  | <p>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 <sup>(2)</sup> oder in einer anderen Kontraktart eingegangen wurde.</p>  | <p>„OPTN“ — Optionen, einschließlich getrennt handelbarer Optionen auf die Arten FUTR, SDRV oder OTHR, außer Produkten mit lediglich eingebetteter Optionalität</p> <p>„FUTR“ — Terminkontrakte</p> <p>„EMIS“ — Emissionszertifikate und Derivate davon</p> <p>„SDRV“ — Warenderivate im Sinne von Artikel 4 Absatz 1 Nummer 44 Buchstabe c der Richtlinie 2014/65/EU</p> <p>„OTHR“ — alle sonstigen Kontraktarten</p> |
| Fälligkeit der Position       | <p>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.</p>  | <p>„SPOT“ — Spot-Monat, einschließlich aller Positionen in EMIS und SRDV</p> <p>„OTHR“ — alle anderen Monate</p>   |
| Größe der Position            | <p>Größe der Nettoposition im Warenderivat, Emissionszertifikat oder Derivaten davon, ausgedrückt als Lose, wenn die Positionslimits in Losen ausgedrückt werden, oder als Einheiten des Basiswerts.</p> <p>Angabe einer positiven Zahl für Kaufpositionen und einer negativen Zahl für Verkaufspositionen.</p> <p>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.</p> | {DECIMAL-15/2}   |
| Angabe der Größe der Position | <p>Angabe der für die Meldung der Größe der Position verwendeten Einheiten.</p>   | <p>„LOTS“ — bei Angabe der Größe der Position in Losen</p> <p>{ALPHANUM-25} — Beschreibung der verwendeten Einheiten bei Angabe der Größe der Position in Einheiten des Basiswerts</p> <p>„UNIT“ — bei Angabe der Größe der Position in Einheiten</p>  |

| FELD  | ZU MELDENDE ANGABEN  | BERICHTSFORMAT  |
|---|--|---|
| 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.<br><br>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.<br>„FALSE“ — Die Position verringert das Risiko nicht. |

(<sup>1</sup>) 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).

(<sup>2</sup>) 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).