

# CSDR Reference Data (CSR)

## Daten zur Unterstützung bei der Umsetzung der CSD-Regulierung

- **Umfassender Datenset für die Erfüllung der CSDR**
- **Europaweite Abdeckung**
- **Hohe Transparenz für Finanzplatzteilnehmer**

Im Rahmen der Aufarbeitung der Finanzkrise wurde auch die Wertpapierabwicklung, eines der zentralen Glieder in der Wertschöpfungskette von Wertpapiergeschäften, als ein wesentliches Risiko identifiziert. Hierfür wurde 2014 die Verordnung (EU) 909/2014 (Central Securities Depositories Regulation – CSDR), die zur Vereinheitlichung des Regimes für Zentralverwahrer („CSDs“) innerhalb der EU insbesondere regelt, erlassen.

Am 23. Juli 2014 wurde die Verordnung (EU) Nr. 909/2014 (CSDR) zur Verbesserung der Wertpapierlieferungen und Wertpapierabrechnungen in der Europäischen Union veröffentlicht. Die vom 11. November 2016 stammende Delegierte Verordnung (EU) 2017/389 und die vom 25. Mai 2018 stammende Delegierte Verordnung (EU) 2018/1229 ergänzen die CSDR.

Kapitel III der CSDR zur Abwicklungsdisziplin regelt in Art. 7 Maßnahmen gegen gescheiterte Abwicklungen. Sie richtet sich an Zentralverwahrer und an Teilnehmer eines Wertpapierliefer- und Wertpapierabrechnungssystems. Betroffen sind Handelsparteien, zentrale Gegenparteien (Central Counterparties – CCPs) und Handelsplätze, die einige der Maßnahmen direkt einhalten müssen, insbesondere die Einführung von obligatorischen Buy-Ins und Strafen für Auslegungsfehler.

Das Hauptziel der CSDR ist es die Sicherheit und Effizienz der Wertpapierabwicklung und der Abwicklungsinfrastruktur in der EU zu erhöhen.

WM stellt für die Erfüllung dieser Anforderungen verschiedene Datenfelder in dem Produkt CSR zur Verfügung.

Diese sind:

### KENNZEICHEN HAUPTHANDELSPLATZ DRITTLAND

Kennzeichnung, wenn der Haupthandelsplatz einer Aktie in einem Drittland liegt (Art. 7 (13) CSDR).

### LIQUIDESTER MARKT

Darstellung des MIC Codes des liquidesten Marktes des Finanzinstruments (Art. 7 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/389).

### ABWICKLUNGSDISZIPLIN CSDR

Darstellung des Verlängerungszeitraums (Art. 7 (3/4) CSDR) sowie des Sanktionssatzes zur Berechnung der Höhe der Geldbuße bei gescheiterten Abwicklungen (Art. 7 (2) CSDR). Ergänzend ist noch ein Kennzeichen für einen KMU-Wachstumsmarkt enthalten.

Folgende Felder werden aufgrund fachlicher Zusammenhänge aus anderen Produkten ebenfalls in das Produkt CSR aufgenommen:

- KLASSIFIKATION FINANZINSTRUMENTE NACH CSDR ART. 9 (T2S)
- KENNZEICHEN-LIQUIDITÄT-MIFID II/MIFIR (MiR)
- KENNZEICHEN KMU WACHSTUMSMARKT (MiR)

Die CSDR tritt zum 19. September 2020 in Kraft. Die Produktivnahme der neuen Felder ist für den 11. März 2020 vorgesehen.

Bsp. für die neuen CSR-Felder:

WKN	KZ Haupthandelsplatz Drittland	Abwicklungsdisziplin in CSDR (Teilfeld Markt)	Abwicklungsdisziplin CSDR (Teilfeld Verlängerungszeitraum)	Abwicklungsdisziplin CSDR (Teilfeld Sanktionssatz)	Liquidester Markt (Handelsplatz)
A2DGDJ (Dotz Nano Ltd. Registered Shares o.N.)	Ja	Keine Belegung	Keine Belegung	Keine Belegung	CHIA
A1R04X (Daimler AG, Medium Term Notes v. 14 (22))	Keine Belegung	A (kein KMU-Wachstumsmarkt)	B (7 Tage)	E (0,20)	Keine Belegung
540868 (ÖKOWORLD AG, Namens-Vorzugsaktien o.St.o.N.)	Keine Belegung	A (kein KMU-Wachstumsmarkt)	B (7 Tage)	B (0,50)	XETS
		B (KMU-Wachstumsmarkt)	C (bis zu 15 Tage)	C (0,25)	

Kontakt:

Tel.: +49 (0) 69 2732-100

Fax: +49 (0) 69 2732-291

E-Mail: sales@wmdata.com

WM Datenservice

Düsseldorfer Straße 16

60329 Frankfurt a. M., Germany

wmdata.com

