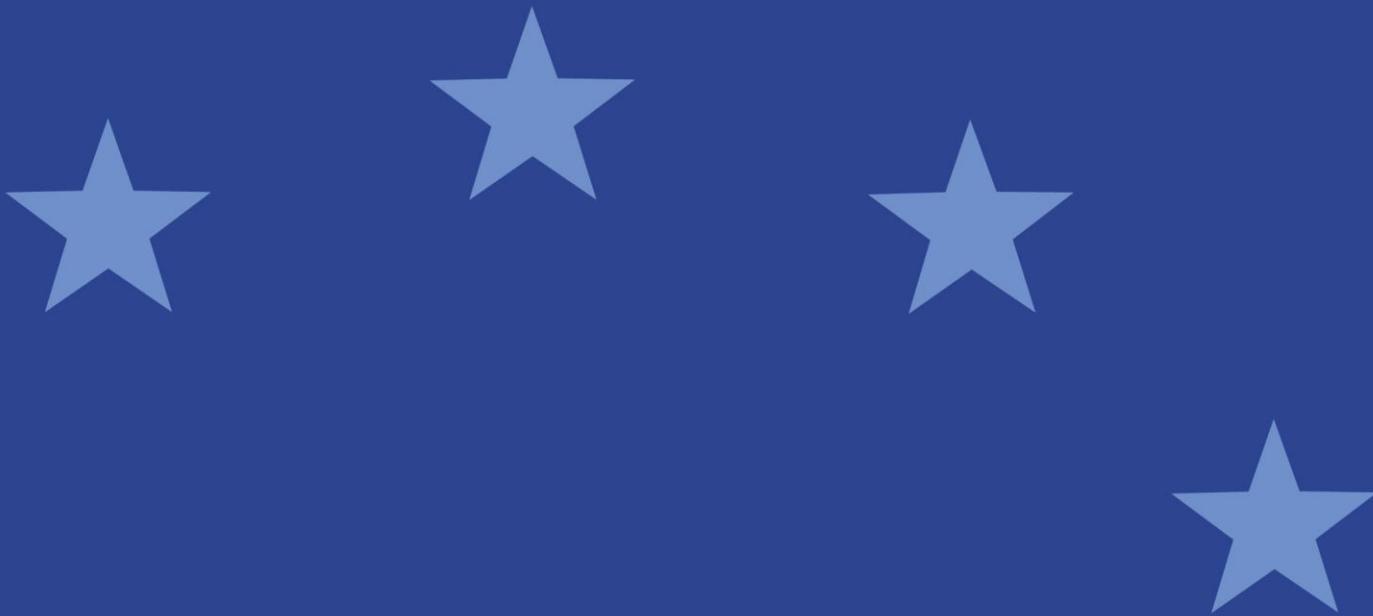




European Securities and  
Markets Authority

# Leitlinien

**Zum Verfahren der Berechnung der Indikatoren zur Bestimmung der wesentlichen Bedeutung eines Zentralverwahrers für einen Aufnahmemitgliedstaat**



## Inhaltsverzeichnis

<b>Zum Verfahren der Berechnung der Indikatoren zur Bestimmung der wesentlichen Bedeutung eines Zentralverwahrers für einen Aufnahmemitgliedstaat .....</b>	<b>0</b>
I. Zusammenfassung.....	2
1 Gründe für die Veröffentlichung.....	2
2 Inhalt .....	5
3 Nächste Schritte .....	5
II. Leitlinien zum Verfahren der Berechnung der Indikatoren zur Bestimmung der wesentlichen Bedeutung eines Zentralverwahrers für einen Aufnahmemitgliedstaat .....	6
1 Anwendungsbereich.....	6
2 Begriffsbestimmungen.....	6
4 Einhaltung der Leitlinien und Mitteilungspflichten .....	7
4.1 Status der Leitlinien.....	7
4.2 Mitteilungspflichten.....	7
5 Leitlinien zur Bestimmung der wesentlichen Bedeutung eines Zentralverwahrers für einen Aufnahmemitgliedstaat .....	8
5.1 Umfang der von den Zentralverwahrern zu meldenden Daten.....	8
5.2 Allgemeines Verfahren zur Erhebung der Datenangaben und zur Berechnung der Indikatoren zur Bestimmung der wesentlichen Bedeutung eines Zentralverwahrers für einen Aufnahmemitgliedstaat .....	10
5.3 Anfangsverfahren zur Erhebung der Datenangaben und zur Berechnung der Indikatoren zur Bestimmung der wesentlichen Bedeutung eines Zentralverwahrers für einen Aufnahmemitgliedstaat .....	11
6 ANHANG.....	13
6.1 Mustertexte für die Erhebung der Daten für die Indikatoren zur Bestimmung der wesentlichen Bedeutung.....	13

# I. Zusammenfassung

## 1 Gründe für die Veröffentlichung

1. In Artikel 24 der Verordnung (EU) Nr. 909/2014<sup>1</sup> (Verordnung über Zentralverwahrer) sind verschiedene Maßnahmen für die Zusammenarbeit zwischen den zuständigen Behörden des Herkunfts- und des Aufnahmemitgliedstaats festgelegt, wenn ein Zentralverwahrer seine Dienstleistungen grenzüberschreitend erbringt. Insbesondere sieht Artikel 24 Absatz 4 der Verordnung über Zentralverwahrer vor, dass die zuständigen Behörden des Herkunfts- und des Aufnahmemitgliedstaats formelle Kooperationsvereinbarungen zur Beaufsichtigung der Tätigkeit des Zentralverwahrers treffen, wenn seine Tätigkeit in Anbetracht der Lage an den Wertpapiermärkten des Aufnahmemitgliedstaats „wesentliche Bedeutung für das Funktionieren der dortigen Wertpapiermärkte und den dortigen Anlegerschutz erlangt“.
2. In der Delegierten Verordnung (EU) 2017/392 der Kommission<sup>2</sup> sind die Kriterien festgelegt, unter denen die Tätigkeiten eines Zentralverwahrers in einem Aufnahmemitgliedstaat als von „wesentlicher Bedeutung für das Funktionieren der Wertpapiermärkte und den Anlegerschutz“ in dem Aufnahmemitgliedstaat angesehen werden. Für die Berechnung der auf diesen Kriterien basierenden relevanten Indikatoren müssen die zuständigen Behörden auf EU-Ebene aggregierte Angaben verwenden. Allerdings können die jeweiligen zuständigen Behörden Schwierigkeiten bei der Erhebung und Zusammenfassung aller relevanten Angaben von den Zentralverwahrern in der EU haben. Zudem kann ein solcher Ansatz auch zu Doppelarbeit bei den zuständigen Behörden führen und Risiken hinsichtlich der Verwendung inkonsistenter Daten bergen.
3. Da für die Berechnung der in der Delegierten Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission genannten, auf diesen Kriterien basierenden relevanten Indikatoren konsistente, auf EU-Ebene aggregierte Angaben verwendet werden müssen, hat die ESMA beschlossen, Leitlinien für das Verfahren zur Erhebung, Verarbeitung und Aggregation der Daten und Angaben, die für die Berechnung der Indikatoren zur Bestimmung der wesentlichen Bedeutung eines Zentralverwahrers für einen Aufnahmemitgliedstaat erforderlich sind, zu veröffentlichen.
4. Es ist Aufgabe der ESMA, zur einheitlichen Anwendung der rechtsverbindlichen Rechtsakte der Union beizutragen, und zwar insbesondere mit ihrem Beitrag zu einer gemeinsamen Aufsichtskultur durch die Einführung einer einheitlichen, effizienten und wirksamen Aufsichtspraxis, und deshalb sollte die ESMA bei der Zentralisierung und

---

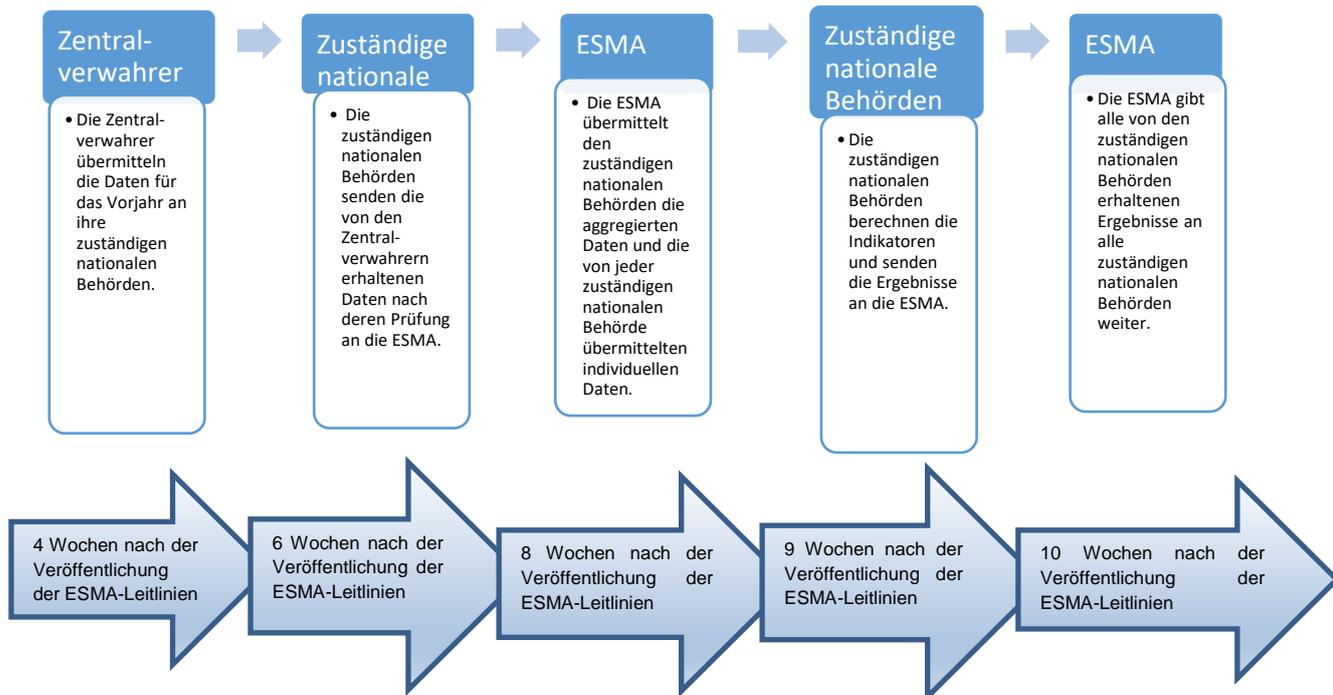
<sup>1</sup> Verordnung (EU) Nr. 909/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 23. Juli 2014 zur Verbesserung der Wertpapierlieferungen und -abrechnungen in der Europäischen Union und über Zentralverwahrer sowie zur Änderung der Richtlinien 98/26/EG und 2014/65/EU und der Verordnung Nr. 236/2012 (ABl. L 257 vom 28.8.2014, S. 1).

<sup>2</sup> Delegierte Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission vom 11. November 2016 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 909/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf die Parameter für die Berechnung von Geldbußen für gescheiterte Abwicklungen und die Tätigkeiten von CSD in Aufnahmemitgliedstaaten (ABl. L 65 vom 10.3.2017, S. 1-8).

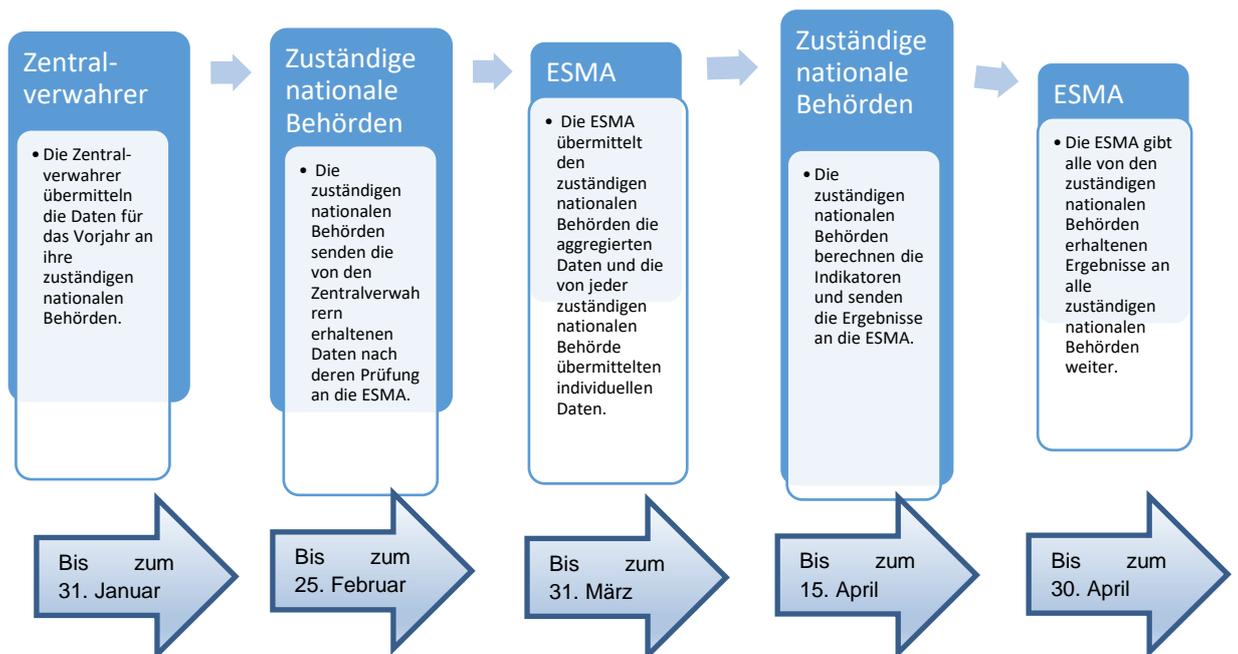
Aggregation der von den Zentralverwahrern einschließlich den als Zentralverwahrer fungierenden Zentralbanken erhaltenen Daten eine koordinierende Rolle übernehmen. Die zuständigen Behörden sollten die Berechnungen für die Indikatoren auf der Grundlage der von der ESMA zentralisierten und aggregierten Daten durchführen.

5. Auch wenn die Indikatoren nicht für als Zentralverwahrer fungierende Zentralbanken berechnet werden (da diese gemäß Artikel 1 Absatz 4 der Verordnung über Zentralverwahrer von bestimmten für Zentralverwahrer geltenden Anforderungen ausgenommen sind), ist es wichtig, dass als Zentralverwahrer fungierende Zentralbanken die relevanten Daten übermitteln, die zur Bestimmung der Werte für die Nenner verwendet werden, um für die jeweiligen Indikatoren ein vollständiges Bild der Tätigkeiten auf EU-Ebene zu erhalten.
6. Um eine einheitliche Anwendung der einschlägigen Bestimmungen der Delegierten Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission zu gewährleisten, wird in den Leitlinien der Umfang der für die Berechnung der relevanten Indikatoren zu meldenden Daten präzisiert, indem Beispiele für die Arten der Transaktionen und Geschäfte angeführt werden, die einzubeziehen bzw. nicht einzubeziehen sind.
7. Mit dem selben Ziel und insbesondere zur Gewährleistung eines harmonisierten und einheitlichen Ansatzes für die Datenmeldung aller Zentralverwahrer zur Berechnung der auf den in Artikel 6 Absatz 1 Buchstaben a und b der Delegierten Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission genannten Kriterien basierenden Indikatoren werden in diesen Leitlinien gemeinsame Parameter für die Meldung von Abwicklungsanweisungen vorgeschlagen (d. h. ohne doppelte Zählung von Abwicklungsanweisungen je nach Art ihrer Abwicklung: über oder nicht über Zentralverwahrer-Verbindungen). Diese Parameter würden die Anwendung materiellrechtlicher Vorschriften auf die Abwicklung, einschließlich in Bezug auf die Richtlinie 98/26/EG und die nationalen Wertpapier- und Eigentumsrechte, nicht beeinträchtigen.
8. Bezüglich des Zeitpunkts des Inkrafttretens der Delegierten Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission wird in diesen Leitlinien ein allgemeines Verfahren für die Datenerhebung und die Indikatorenberechnung ab dem 1. Januar 2018 sowie ein Anfangsverfahren für die erstmalige Anwendung des allgemeinen Verfahrens im Jahr 2017 für den Berichtszeitraum vom 1. Januar bis zum 31. Dezember 2016 beschrieben.

## Überblick über das Anfangsverfahren (Anwendung im Jahr 2017)



## Überblick über das Allgemeine Verfahren (Anwendung ab dem 1. Januar 2018)



## **2 Inhalt**

9. Abschnitt II enthält den vollständigen Wortlaut der Leitlinien zum Verfahren der Berechnung der Indikatoren zur Bestimmung der wesentlichen Bedeutung eines Zentralverwahrers für einen Aufnahmemitgliedstaat.

## **3 Nächste Schritte**

10. Die Leitlinien in Abschnitt II werden in die Amtssprachen der Europäischen Union übersetzt und auf der Website der ESMA veröffentlicht.

## **II. Leitlinien zum Verfahren der Berechnung der Indikatoren zur Bestimmung der wesentlichen Bedeutung eines Zentralverwahrers für einen Aufnahmemitgliedstaat**

### **1 Anwendungsbereich**

#### **Wer?**

1. Diese Leitlinien gelten für die in der Verordnung (EU) Nr. 909/2014<sup>3</sup> (Verordnung über Zentralverwahrer) benannten zuständigen Behörden.

#### **Was?**

2. Diese Leitlinien gelten für das Verfahren zur Erhebung, Verarbeitung und Aggregation der Daten und Angaben, die für die Berechnung der Indikatoren zur Bestimmung der wesentlichen Bedeutung eines Zentralverwahrers für das Funktionieren der Wertpapiermärkte und den Anlegerschutz in einem Aufnahmemitgliedstaat gemäß Artikel 24 Absatz 4 der Verordnung über Zentralverwahrer erforderlich sind.

#### **Wann?**

3. Diese Leitlinien treten am 28/03/2018.

### **2 Begriffsbestimmungen**

4. Die in diesen Leitlinien verwendeten Begriffe haben die gleiche Bedeutung wie in der Verordnung über Zentralverwahrer und in der Delegierten Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission<sup>4</sup>.

### **3 Zweck**

5. Zweck dieser Leitlinien ist es, eine gemeinsame, einheitliche und kohärente Anwendung der Bestimmungen nach Artikel 24 Absatz 4 der Verordnung über Zentralverwahrer zu gewährleisten. Sie bieten insbesondere eine Orientierungshilfe für das Verfahren zur Erhebung, Verarbeitung und Aggregation der Daten und Angaben, die für die Berechnung der Indikatoren zur Bestimmung der wesentlichen Bedeutung eines Zentralverwahrers für

---

<sup>3</sup> Verordnung (EU) Nr. 909/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 23. Juli 2014 zur Verbesserung der Wertpapierlieferungen und -abrechnungen in der Europäischen Union und über Zentralverwahrer sowie zur Änderung der Richtlinien 98/26/EG und 2014/65/EU und der Verordnung Nr. 236/2012 (ABl. L 257 vom 28.8.2014, S. 1).

<sup>4</sup> Delegierte Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission vom 11. November 2016 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 909/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf die Parameter für die Berechnung von Geldbußen für gescheiterte Abwicklungen und die Tätigkeiten von CSD in Aufnahmemitgliedstaaten (ABl. L 65 vom 10.3.2017, S. 1-8).

das Funktionieren der Wertpapiermärkte und den Anlegerschutz in einem Aufnahmemitgliedstaat erforderlich sind.

## 4 Einhaltung der Leitlinien und Mitteilungspflichten

### 4.1 Status der Leitlinien

6. Dieses Dokument enthält Leitlinien, die gemäß Artikel 16 der ESMA-Verordnung<sup>5</sup> herausgegeben werden. Gemäß Artikel 16 Absatz 3 der ESMA-Verordnung unternehmen die zuständigen Behörden und die Finanzmarktteilnehmer alle erforderlichen Anstrengungen, um diesen Leitlinien und Empfehlungen nachzukommen.
7. Die von diesen Leitlinien betroffenen zuständigen Behörden sollten diesen nachkommen, indem sie sie in ihre Aufsichtspraxis übernehmen.

### 4.2 Mitteilungspflichten

8. Die zuständigen Behörden, an die sich diese Leitlinien richten, müssen der ESMA binnen zwei Monaten nach Veröffentlichung dieser Leitlinien unter [*an: csdr.data@esma.europa.eu*] mitteilen, ob sie den Leitlinien nachkommen oder nachzukommen beabsichtigen, und gegebenenfalls die Gründe nennen, warum sie diesen nicht nachkommen oder nicht nachzukommen beabsichtigen. Geht innerhalb dieser Frist keine Mitteilung ein, wird davon ausgegangen, dass die zuständigen Behörden den Leitlinien nicht nachkommen. Eine Vorlage für entsprechende Mitteilungen steht auf der ESMA-Website zur Verfügung. Um jedoch eine reibungslose und rechtzeitige Durchführung des Verfahrens zur Erhebung, Verarbeitung und Aggregation der Daten zu gewährleisten, die für die Berechnung der in diesen Leitlinien genannten Indikatoren erforderlich sind, sollten die zuständigen Behörden die ESMA so bald wie möglich, vorzugsweise innerhalb von zwei Wochen nach dem Veröffentlichungsdatum, davon in Kenntnis setzen.
9. Als Veröffentlichungsdatum dieser Leitlinien gilt das Datum ihrer Veröffentlichung auf der Website der ESMA in allen Amtssprachen der EU.
10. Zentralverwahrer sind nicht verpflichtet, mitzuteilen, ob sie diesen Leitlinien nachkommen.

---

<sup>5</sup> Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 v. 24.11.2010 des Europäischen Parlaments und des Rates zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Bankenaufsichtsbehörde), 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).

## **5 Leitlinien zur Bestimmung der wesentlichen Bedeutung eines Zentralverwahrers für einen Aufnahmemitgliedstaat**

### **5.1 Umfang der von den Zentralverwahrern zu meldenden Daten**

11. Die zuständigen Behörden sollten dafür sorgen, dass die Zentralverwahrer (einschließlich der als Zentralverwahrer fungierenden Zentralbanken) die relevanten Daten und Angaben in dem im Anhang in den Mustertexten bereitgestellten Format melden. Die Liste der Zentralverwahrer (einschließlich der als Zentralverwahrer fungierenden Zentralbanken) in den im Anhang enthaltenen Mustertexten sollte von den zuständigen Behörden jährlich aktualisiert werden.
12. Alle von den Zentralverwahrern (einschließlich der als Zentralverwahrer fungierenden Zentralbanken) gemeldeten Werte sollten in EUR angegeben werden; zudem sind die verwendeten Wechselkurse zu nennen. Als Wechselkurse sind die Kurse zu verwenden, die am letzten Tag des Kalenderjahres, für das Daten gemeldet werden, gültig sind. Soweit verfügbar, sollte für die Umrechnung anderer Währungen in Euro der Wechselkurs der Europäischen Zentralbank verwendet werden.
13. Für die Zwecke der in Artikel 5 Absatz 1 Buchstaben a und b der Delegierten Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission genannten Kriterien sollten Zentralverwahrer (einschließlich als Zentralverwahrer fungierende Zentralbanken) Daten zu am 31. Dezember des vorangegangenen Kalenderjahres gültigen Wertpapieren verwenden, die keine stornierten Wertpapieremissionen enthalten sollten.
14. Die zuständigen Behörden sollten sicherstellen, dass die Zentralverwahrer (einschließlich die als Zentralverwahrer fungierenden Zentralbanken) für jede ISIN den Marktwert, der am 31. Dezember des vorangegangenen Kalenderjahres gilt und gemäß Artikel 7 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission ermittelt wird, wenn sie den Marktwert für die Zwecke der auf den in Artikel 5 Absatz 1 Buchstaben a und b der Delegierten Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission genannten Kriterien basierenden Indikatoren bestimmen.
15. Die Daten für die auf den in Artikel 6 Absatz 1 Buchstaben a und b der Delegierten Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission genannten Kriterien basierenden Indikatoren sollten die Werte der von jedem Zentralverwahrer abgewickelten Abwicklungsanweisungen enthalten, die auf folgenden Parametern für die Datenmeldung basieren:
  - a) Die Daten sollten die absoluten Werte der Abwicklung durch jeden Zentralverwahrer im vorangegangenen Kalenderjahr enthalten.
  - b) Alle Arten von Abwicklungsanweisungen, die von einem Zentralverwahrer abgewickelt werden, sollten einbezogen werden, unabhängig davon, ob die

betreffenden Transaktionen an einem Handelsplatz oder außerbörslich gehandelt werden.

- c) Bei Geschäften, die aus mehreren Transaktionen bestehen, z. B. Wertpapierpensionsgeschäfte oder Wertpapierleihe, sind beide Seiten nach der Abwicklung zu melden.
- d) Bei einer Abwicklung zwischen Zentralverwahrern sollte der Zentralverwahrer (auf Ausgeberseite bzw. auf Investorenmite) beide Seiten einer Transaktion, d. h. die beiden erhaltenen Abwicklungsanweisungen, melden.
- e) Ist mehr als ein Zentralverwahrer an der Abwicklung einer Transaktion über Standard-, kundenspezifische oder indirekte Verbindungen beteiligt, sollte nur der Zentralverwahrer (auf Ausgeberseite bzw. auf Investorenmite), der die beiden Seiten der Transaktion abwickelt, Bericht erstatten. Er sollte die beiden erhaltenen Abwicklungsanweisungen melden. Der Zentralverwahrer auf Investorenmite, der nur eine Seite der Transaktion „abwickelt“, sollte nicht berichten.
- f) Bei einer mehrere Zentralverwahrer übergreifenden Abwicklung durch Zentralverwahrer, die eine gemeinsame Abwicklungsinfrastruktur oder interoperable Verbindungen nutzen, sollte jeder Zentralverwahrer die im Zusammenhang mit einer Transaktion erhaltene einzelne Abwicklungsanweisung melden.

16. Die Abwicklungsanweisungen können sich auf folgende Arten von Transaktionen beziehen:

- a) Kauf oder Verkauf von Wertpapieren (einschließlich Käufe oder Verkäufe von Wertpapieren auf dem Primärmarkt);
- b) Tätigkeiten des Sicherheitenmanagements (einschließlich Dreiparteien-Sicherheitenmanagement oder Auto-Collateralisation-Geschäfte);
- c) Wertpapierverleih- oder -leihgeschäfte;
- d) Pensionsgeschäfte;
- e) sonstige (einschließlich Kapitalmaßnahmen in Bezug auf Ströme, d. h. Marktforderungen und Umwandlungen).

17. Über die folgenden Arten von Transaktionen muss nicht berichtet werden:

- a) Kapitalmaßnahmen im Bestand, wie etwa Barausschüttungen (z. B. Bardividende, Zinszahlung), Wertpapierausschüttungen (z. B. Aktiendividende, Ausgabe von Gratisaktien), Umstrukturierungen (z. B. Umwandlung, Aktiensplit, Rücknahme, Übernahmeangebot);
- b) Primärmarktaktivitäten, d. h. der Prozess der erstmaligen Schaffung von Wertpapieren;
- c) die Schaffung und Rücknahme von Fondsanteilen, d. h. die technische Schaffung und Rücknahme von Fondsanteilen, sofern die Schaffung und Rücknahme von Fondsanteilen nicht durch Zahlungs- bzw. Übertragungsaufträge in einem von einem Zentralverwahrer betriebenen Wertpapierliefer- und -abrechnungssystem erfolgt;
- d) die Durchführung von Neuausrichtungen.

18. Die in Artikel 6 Absatz 2 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission genannte Ermittlung von Marktwerten zur Abwicklung ohne

Gegenwertverrechnung sollte auf den Werten am Tag der Abrechnung der einzelnen Abwicklungsanweisungen basieren.

19. Das Land, in dem der Emittent seinen Sitz hat, sollte bei dem in Artikel 5 Absatz 1 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission genannten Kriterium berücksichtigt werden.
20. Im Falle von Teilnehmern und anderen Inhabern von Depotkonten im Sinne von Artikel 5 Absatz 1 Buchstabe b und Artikel 6 Absatz 1 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission, die Zweigniederlassungen sind, sollte das Hoheitsgebiet, in dem die Muttergesellschaft ihren Sitz hat, berücksichtigt werden.
21. Die von einem Zentralverwahrer zu meldenden Daten sollten auch die Dienstleistungen umfassen, die in Bezug auf den Herkunftsmitgliedstaat erbracht werden, da diese Daten für die Berechnung der Nenner auf EU-Ebene für die verschiedenen Indikatoren benötigt werden (z. B. für die Zwecke des Kriteriums gemäß Artikel 5 Absatz 1 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission, demzufolge die von einem Zentralverwahrer zu meldenden Daten Wertpapiere umfassen sollten, die von Emittenten aus seinem Herkunftsmitgliedstaat ausgegeben wurden, und nicht nur Wertpapiere, die von Emittenten aus den Aufnahmemitgliedstaaten ausgegeben wurden).

## 5.2 Allgemeines Verfahren zur Erhebung der Datenangaben und zur Berechnung der Indikatoren zur Bestimmung der wesentlichen Bedeutung eines Zentralverwahrers für einen Aufnahmemitgliedstaat

22. Das in diesem Abschnitt vorgeschlagene allgemeine Verfahren sollte ab dem 1. Januar 2018 angewendet werden.
23. Die zuständigen Behörden sollten sicherstellen, dass die Zentralverwahrer einschließlich die als Zentralverwahrer fungierenden Zentralbanken ihnen bis zum 31. Januar jedes Jahres die relevanten Daten und Angaben für das vorangegangene Kalenderjahr übermitteln, die für die Berechnung der auf den in Artikel 5 Absatz 6 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission genannten Kriterien basierenden Indikatoren erforderlich sind (d. h. es sollten Daten vom 1. Januar bis zum 31. Dezember des vorangegangenen Kalenderjahres verwendet werden).
24. Die zuständigen Behörden sollten sicherstellen, dass die Zentralverwahrer einschließlich die als Zentralverwahrer fungierenden Zentralbanken vor dem in Artikel 9 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission genannten Geltungsdatum (zwei Jahre nach der Veröffentlichung der Verordnung im Amtsblatt der EU) nur die Angaben übermitteln, die für die in Artikel 5 Absatz 1 Buchstabe a und Artikel 6 Absatz 1 Buchstabe c der Verordnung genannten Kriterien für die zuständigen Behörden von Belang sind.
25. Nach Prüfung der Daten sollten die zuständigen Behörden der ESMA die Daten, die sie von den Zentralverwahrern einschließlich den als Zentralverwahrer fungierenden Zentralbanken erhalten haben, bis zum 25. Februar jedes Jahres übermitteln.

26. Jede zuständige Behörde sollte die Berechnung der Indikatoren anhand der Kriterien in den Artikeln 5 und 6 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission (sofern zutreffend, für jeden Zentralverwahrer, für den eine zuständige Behörde die zuständige Behörde des Herkunftsmitgliedstaats ist) nach Erhalt der folgenden Daten von der ESMA bis zum 31. März jedes Jahres durchführen:
- a) aller von den einzelnen zuständigen Behörden übermittelten Daten;
  - b) Daten, die die Werte für die Nenner der auf den in den Artikeln 5 und 6 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission genannten Kriterien basierenden Indikatoren aggregieren, sofern zutreffend.
27. Die zuständigen Behörden sollten der ESMA die Ergebnisse der Berechnung für die auf den in den Artikeln 5 und 6 der Delegierten Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission genannten Kriterien basierenden Indikatoren, sofern zutreffend, bis zum 15. April jedes Jahres übermitteln, damit die ESMA diese Informationen bis zum 30. April jedes Jahres an alle zuständigen Behörden weitergeben kann.
28. Das in diesem Abschnitt genannte allgemeine Verfahren sollte ebenfalls angewandt werden, sobald die in Artikel 5 Absatz 1 Buchstabe b und Artikel 6 Absatz 1 Buchstabe a und b der Delegierten Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission genannten Kriterien gemäß Artikel 8 Absatz 2 der Verordnung gelten.

### 5.3 Anfangsverfahren zur Erhebung der Datenangaben und zur Berechnung der Indikatoren zur Bestimmung der wesentlichen Bedeutung eines Zentralverwahrers für einen Aufnahmemitgliedstaat

29. Für die erstmalige Anwendung des allgemeinen Verfahrens im Jahr 2017, die den Berichtszeitraum vom 1. Januar bis zum 31. Dezember 2016 abdeckt, sollten die Zentralverwahrer einschließlich die als Zentralverwahrer fungierenden Zentralbanken sowie die zuständigen Behörden das allgemeine Verfahren unter Verwendung der folgenden Daten anwenden, wobei jedes Datum ab dem Veröffentlichungsdatum dieser Leitlinien berechnet wird:
30. Die Zentralverwahrer einschließlich die als Zentralverwahrer fungierenden Zentralbanken sollten den zuständigen Behörden innerhalb von vier Wochen die relevanten Daten übermitteln, die für die Berechnung der auf den in Artikel 5 Absatz 1 Buchstabe a und Artikel 6 Absatz 1 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission genannten Kriterien basierenden Indikatoren erforderlich sind.
31. Die zuständigen Behörden sollten der ESMA die von den Zentralverwahrern einschließlich den als Zentralverwahrer fungierenden Zentralbanken erhaltenen Daten innerhalb von sechs Wochen übermitteln, damit die ESMA den zuständigen Behörden die aggregierten Daten sowie die von jeder zuständigen Behörde erhaltenen individuellen Daten innerhalb von acht Wochen zusenden kann.

32. Die zuständigen Behörden sollten die Ergebnisse für die auf den in Artikel 5 Absatz 1 Buchstabe a und Artikel 6 Absatz 1 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2017/389 der Kommission genannten Kriterien basierenden Indikatoren (für jeden Zentralverwahrer, für den sie die zuständige Behörde des Herkunftsmitgliedstaats sind), innerhalb von neun Wochen an die ESMA übermitteln, damit die ESMA diese Informationen innerhalb von zehn Wochen an alle zuständigen Behörden weitergeben kann.

## **6 ANHANG**

### 6.1 Mustertexte für die Erhebung der Daten für die Indikatoren zur Bestimmung der wesentlichen Bedeutung