

MiFIR – Meldetool

Version: 180312

Benutzerhandbuch



Inhaltsverzeichnis

Inhaltsverzeichnis	2
Einleitung	3
Handhabungskonzept	3
Eintragen der Daten	3
MiFIR – Meldetool Programm	3
Excel Vorlage	3
Konfiguration	3
BaFin und MVP - Portal	3
Beispielhafte Nutzung	4
Backups	6
Systemumgebung	6
Konfigurationsübersicht	7
Konvertierung einer Excel Datei in das BaFin XML Format	8
Programmaufruf: Art26Melder.jar	8
Konfigurationsdatei: BafinConverter.conf	8
Protokolldatei: MiFIR_MeldeTool.log	8
Melden der XML Datei an das BaFin MVP Portal	9
Programmaufruf: Art26Melder.jar	9
Konfigurationsdatei: BafinSender.conf	9
Protokolldatei: MiFIR_MeldeTool.log	9
Template Nutzung	10
Referenzen Regulatorik	15
Hinweise	15
Änderungshistorie	16
180309	16
180124	16
180117	16
180112	16
171227	16
171222	17

Einleitung

Dieses Benutzerhandbuch beschreibt, wie das MiFIR-Meldetool installiert und genutzt werden soll. Vermögensverwalter nutzen das MiFIR-Meldetool, um meldepflichtige Transaktionen an die zuständige Aufsichtsbehörde zu melden.

Handhabungskonzept

Eintragen der Daten

Der Benutzer trägt die Transaktionsdaten selbständig in die Excel – Vorlage ein. Die Dokumente im Ordner Regulatorik enthalten Hinweise zu den aufsichtsrechtlichen Anforderungen und den Bedeutungen der einzelnen Felder. Der Benutzer muss seine Transaktionsdaten im Hinblick auf diese Anforderungen eigenständig interpretieren und bewerten, um Daten richtig in die Excel-Vorlage eintragen zu können. Das MiFIR-Meldetool unterstützt zwar die korrekte Datenerfassung durch einige fachliche Validierungen, die richtige Erfassung bleibt jedoch in Verantwortung des Benutzers.

MiFIR – Meldetool Programm

Das MiFIR – Meldetool besteht aus zwei Teilen:

- 1) Konverter: Übersetzt das Excel Template in die XML – Zielstruktur
- 2) Sender: Sender die XML – Zielstruktur an die BaFin

Es handelt sich bei diesem Tool um ein Java Programm. Das Programm kann entweder direkt über Kommandozeile oder mit Doppelklick auf die vorbereiteten BAT – Dateien ausgeführt werden.

Excel Vorlage

Die Excel – Vorlage dient der Erfassung einzelner Felder für Transaktionsmeldungen. Die hier eingetragenen Informationen können anschließend in das XML – Zielformat konvertiert und an die BaFin gesendet werden (mehr dazu in Template Nutzung). Außerdem enthält die Excel-Vorlage Informationen zur Bedeutung der Felder und Beispiele, wie einzelne Zellen zu einzutragen sind.

Konfiguration

Das Programm besitzt zwei Konfigurationsdateien: „BafinConvert.conf“ und „BafinSender.conf“. Diese Dateien konfigurieren jeweils ein Teil des MiFIR – Meldetools. Mehr dazu in der Konfigurationsübersicht.

BaFin und MVP - Portal

Die Transaktionen werden an die BaFin gemeldet. Dafür werden Zugangsdaten zum MVP – Portal benötigt. Das Portal ist unter folgender URL erreichbar:

<https://portal.mvp.bafin.de/MvpPortalWeb/app/login.html>

Um Transaktionsdaten melden zu können, muss der Benutzer selbständig einen Zugang zum Fachverfahren „Transaktionsmeldungen (Art. 26 MiFIR)“ bei der BAfin beantragen. Außerdem sollte auch ein Zugang zum Fachverfahren „Test: Transaktionsmeldungen (Art. 26 MiFIR)“ beantragt werden.

Im MVP – Portal unter „Protokol einsehen“ sind alle Meldungen und deren Status vorzufinden.

Beispielhafte Nutzung

1: Daten in den Konfigurationsdateien „BafinConverter.conf“ und „BafinSender.conf“ einpflegen:

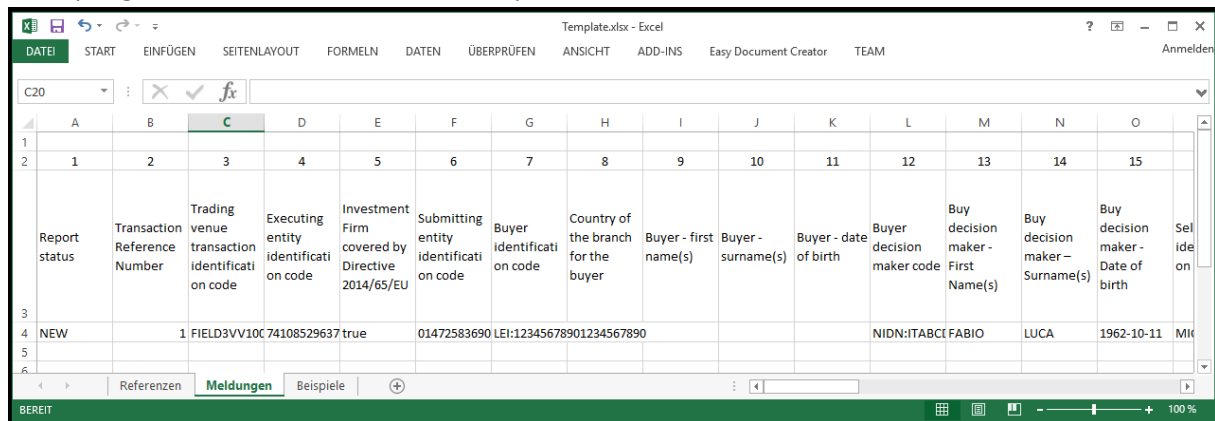
„BafinConverter.conf“

```
{
  "excelPath" : "Template.xlsx",
  "xmlDestination" : "A26MiFIR_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX_Report.xml",
  "allowRowValidation" : "true",
  "fromLEI" : "01234567890123456789"
}
```

„BafinSender.conf“

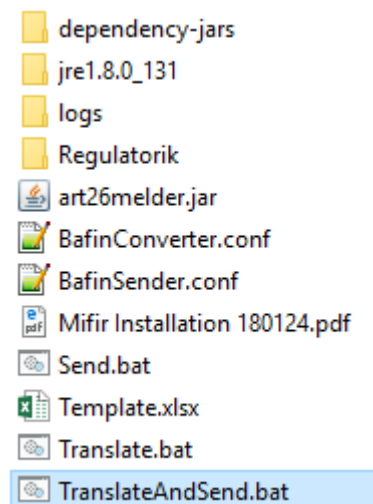
```
{
  "username": "max.muster9574",
  "password": "OKsKqwdNds",
  "usertoken": "hg_95_9502840284",
  "xmlPath": "A26MiFIR_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX_Report.xml",
  "test": true
}
```

2: Einpflegen der Daten in das Excel – Template:



Report status	Transaction Reference Number	Trading venue transaction identification code	Executing entity identification code	Investment Firm covered by Directive 2014/65/EU	Submitting entity identification code	Buyer identification code	Country of the branch for the buyer	Buyer - first name(s)	Buyer - surname(s)	Buyer - date of birth	Buyer decision maker code	Buy decision maker - First Name(s)	Buy decision maker - Surname(s)	Buy decision maker - Date of birth	Seller identification code
NEW	1	FIELD3VV10C	74108529637	true	01472583690	LEI:12345678901234567890					NIDN:ITABCCI	FABIO	LUCA	1962-10-11	MIK

3: Doppelklick auf „TranslateAndSend.bat“:



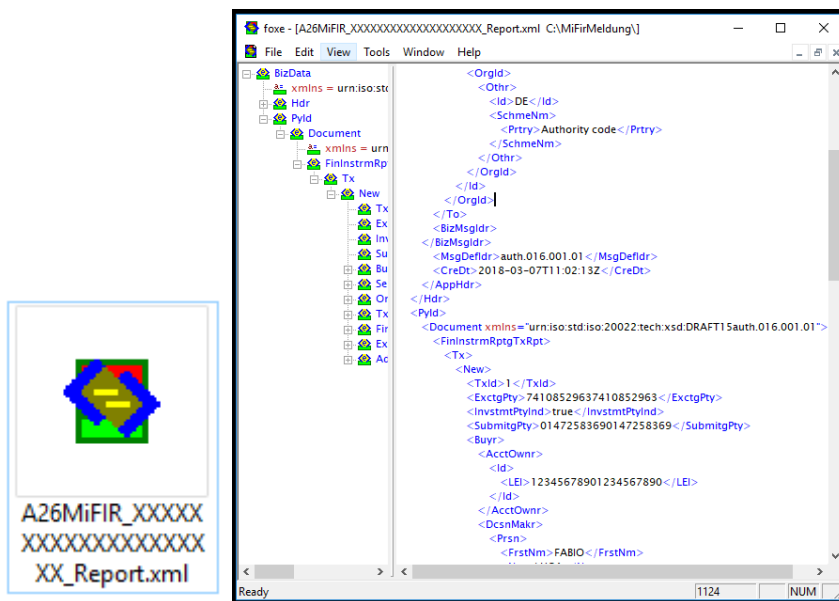
Das MiFIR – Meldetool konvertiert zuerst die Excel – Tabelle in das XML – Zielformat und sendet es anschließend an die BaFin.

```
C:\WINDOWS\system32\cmd.exe
C:\MiFirmeldung>jre1.8.0_131\bin\java -jar Art26Melder.jar -c BafinConverter.conf
2018-03-07 11:02:13 - INFO : Programm: Start.
2018-03-07 11:02:13 - INFO : Option: Converter.
2018-03-07 11:02:13 - INFO : Header wird erstellt.
2018-03-07 11:02:13 - INFO : Excel wird geparsed: Template.xlsx
2018-03-07 11:02:16 - INFO : Aktuelle Reihe: 4
2018-03-07 11:02:17 - INFO : Parsen abgeschlossen.
2018-03-07 11:02:17 - INFO : Xml-Datei Pfad: A26MiFIR_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX_Report.xml
2018-03-07 11:02:17 - INFO : Programm: Ende. 0

C:\MiFirmeldung>jre1.8.0_131\bin\java -jar Art26Melder.jar -s BafinSender.conf
2018-03-07 11:02:18 - INFO : Programm: Start.
2018-03-07 11:02:18 - INFO : Option: Sender.
2018-03-07 11:02:24 - INFO : Creating Service {http://www.bafin.de/mvp/a26mifir/}MVP_
A26MiFIR from WSDL: https://portal.mvp.bafin.de:444/services/ws/a26mifir?wsdl
2018-03-07 11:02:26 - INFO : Testbericht
2018-03-07 11:02:26 - INFO : File: A26MiFIR_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX_Report.xml
2018-03-07 11:02:27 - INFO : Erfolgreiche Meldung: 2018-03-07T10:02:27.126Z -> 673859
5, null
2018-03-07 11:02:27 - INFO : Programm: Ende. 0
```

4: Überprüfen der Protokollierung und XML – Zielstruktur:

Das XML – Zielformat „A26MiFIR_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX_Report.xml“ ist erstellt worden:



Öffnen der Protokoll – Datei „\logs\MiFIR_MeldeTool.log“:

```

INFO : Programm: Start.
INFO : Option: Converter.
INFO : Header wird erstellt.
INFO : Excel wird geparsed: Template.xlsx
INFO : Aktuelle Reihe: 4
INFO : Parsen abgeschlossen.
INFO : Xml-Datei Pfad: A26MiFIR_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX_Report.xml.
INFO : Programm: Ende. 0
INFO : Programm: Start.
INFO : Option: Sender.
INFO : Creating Service {http://www.bafin.de/mvp/a26mifir/}MVP_A26MiFIR
INFO : Testbericht
INFO : File: A26MiFIR_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX_Report.xml
INFO : Erfolgreiche Meldung: 2018-03-07T10:02:27.126Z -> 6738595, null
INFO : Programm: Ende. 0
  
```

Das Programm protokolliert eine erfolgreiche Konvertierung und Meldung (Keine Error – Angaben).

5: Überprüfen des Eingangs im MVP – Portal der BaFin:

Id	↕ Meldezeitpunkt	↕ Fachverfahren	↕ Einreichung	↕ Meldepflichtiger	↕ Kundenreferenz	↕ Meldeweg	↕ Dateiname	↕ Status
	Rückmeldung (Text)			Rückmeldung (Datei)				
6738595	07.03.2018 11:02:27	TEST: Transaktionsmelde (Art. 26 MiFIR)	Hochladen einer Melde-datei	vv.de Finanzdatensystem GmbH, Dormagen		Webservice (MTOM)	A26MiFIR_XXXXXX	In Verarbeitung

Nach spätestens 7 Tagen gibt BaFin Rückmeldung, ob die Transaktionsmeldung erfolgreich oder fehlerhaft gewesen ist.

Backups

Das Programm erstellt keine Backups. Falls Backups erwünscht sind, sind diese eigenständig zu pflegen. Die generierte XML – Zieldatei wird bei jeder Konvertierung gelöscht und neu erstellt. Falls diese Daten nicht verloren gehen sollen, muss der Benutzer diese Datei selbstständig archivieren.

Systemumgebung

Systemanforderung:

Betriebssystem:	Windows	(wegen Excel)
weiteres:	Excel	(Template Nutzung)
	Internet	(Versand der Meldung)

Es wird das Java Runtime Environment der Version 1.8.0_131 mitgeliefert und genutzt. Damit stellen wir sicher, dass das Programm ohne Komplikationen direkt lauffähig ist.

Falls eine eigene JRE genutzt werden möchte, kann dies direkt über Kommandozeile aufrufen oder über anpassen der BAT – Dateien eingestellt werden. Die BAT – Dateien müssen lediglich folgendermaßen angepasst werden:

Entferne den Text: „jre1.8.0_131\bin\“ aus den BAT – Dateien.

Konfigurationsübersicht

Datei / Pfad	Funktion
Mifir Installation.pdf	Installationsdokumentation
Translate.bat	Aufruf art26melder.jar als Konverter
Send.bat	Aufruf art26melder.jar als Sender
TranslateAndSend.bat	Aufruf art26melder.jar als Konverter + Aufruf art26melder.jar als Sender
Art26Melder.jar	Konvertierung Excel zu ISO-20022 XML Format
BafinConverter.conf	Konfigurationsparameter Konverter
BafinSender.conf	Konfigurationsparameter Sender
\logs\ MiFIR_MeldeTool.log	Protokolldatei des MeldeTools
Template.xlsx	Beispiel Meldedatei im Excel Format
A26MiFIR_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX_ Report.xml	Meldedatei im XML Format
\logs	Protokolldateien
\jre1.8.0_131	Java Runtime Engine
\dependency-jars	Verwendete Programmbibliotheken
\Regulatorik	Regulatorische Grundlagen

Konvertierung einer Excel Datei in das BaFin XML Format

Programmaufruf: Art26Melder.jar

Beispielaufruf

```
jre1.8.0_131\bin\java -jar art26melder.jar -c BafinConverter.conf
```

Parameter

- jre1,8,0_131\bin\java Verwendete Java Runtime (optional)
- -jar Aufruf einer Java Datei
- art26melder.jar Programmdatei
- -c Programmoption „Converter“
- BafinConverter.conf Name der Konfigurationsdatei

Konfigurationsdatei: BafinConverter.conf

Beispiel

```
{  
  "excelPath" : "Template.xlsx",  
  "xmlDestination" : "A26MiFIR_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX_Report.xml",  
  "fromLEI" : "000000XXXXXXXXXXXX000"  
}
```

Parameter

- excelPath: Verzeichnis und Name der ImportExcel-Tabelle
- xmlDestination: Ziel-Verzeichnis und Name der generierten XML-Datei
- fromLEI: LEI als Sender-Referenz (20 Stellen)

Protokolldatei: MiFIR_MeldeTool.log

```
2018-01-12 10:57:21 - INFO de.vv.art26melder.App - Option: Converter.  
2018-01-12 10:57:22 - INFO d.v.a.converter.BusinessMessage - Header wird erstellt.  
2018-01-12 10:57:22 - INFO d.v.a.converter.BusinessMessage - Excel wird geparsed: Templ  
2018-01-12 10:57:24 - INFO d.v.art26melder.converter.XLSXReader - Aktuelle Reihe: 4
```


Melden der XML Datei an das BaFin MVP Portal

Programmaufruf: Art26Melder.jar

Beispielaufruf

```
jre1.8.0_131\bin\java -jar art26melder.jar -s BafinSender.conf
```

Parameter

- jre1,8,0_131\bin\java Verwendete Java Runtime (optional)
- -jar Aufruf einer Java Datei
- art26melder.jar Programmdatei
- -s Programmoption: „Senden“
- BafinSender.conf Name der Konfigurationsdatei

Konfigurationsdatei: BafinSender.conf

Beispiel

```
{  
  "username": "max.muster8475",  
  "password": "oik7KuJJ12",  
  "usertoken": "op_42_5479854320",  
  "xmlPath": "A26MiFIR_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX_Report.xml",  
  "test": true  
}
```

Parameter

- username: MVP Meldeportal Benutzername
- password: MVP Meldeportal Passwort
- usertoken: MVP Meldeportal Identifikationsnummer des Meldepflichtigen
- test: true: Meldung über: TEST: Transaktionsmeldung (Art. 26 MiFIR)s
false: Meldung über: Transaktionsmeldung (Art. 26 MiFIR)

Protokolldatei: MiFIR_MeldeTool.log

```
2018-01-12 10:57:27 - INFO de.vv.art26melder.App - Option: Sender.  
2018-01-12 10:57:33 - INFO o.a.c.w.s.f.ReflectionServiceFactoryBean - Creating Se  
2018-01-12 10:57:34 - INFO de.vv.art26melder.sender.Sender - Testbericht  
2018-01-12 10:57:34 - INFO de.vv.art26melder.sender.Sender - File: A26MiFIR_XXXXX  
2018-01-12 10:57:36 - INFO de.vv.art26melder.sender.Sender - Erfolgreiche Meldung:
```

Template Nutzung

Das Konvertieren des Excel Dokumentes findet **immer im zweiten Worksheet** statt (das Worksheet an Position 2 mit Namen „Meldungen“) und **beginnt mit der Zeile 4** (das ist die erste Zeile unterhalb der Spaltenüberschriften). Bei strukturell veränderter Tabelle wird keine Funktionalität garantiert. Das Worksheet mit Namen „Referenzen“ beinhaltet Angaben zu der implementierten Logik. Das Worksheet „Beispiele“ beinhaltet Beispiele zu dieser zusätzlichen Logik.

Die folgende Tabelle soll helfen die Felder richtig einzutragen. Zusätzlich dazu ist empfohlen „\Regulatorik\2016-1521_annex_1_mifir_transaction_reporting_validation_rules.xlsx“ anzuschauen.

Feld	Name	Regel	
		Auswahl	Bedeutung
1	Report Status	NEW	neue Transaktion
		CLX	Stornierung einer Transaktion
2	Transaction Reference Number	Referenznummer des Geschäfts	
3	Trading venue transaction identification code	Vom Handelsplatz vergebener Identifikationscode für das Geschäft	
4	Executing entity identification code	Identifikationscode der ausführenden Einrichtung (LEI)	
5	Investment Firm covered by Directive 2014/65/EU	TRUE	Wertpapierfirma fällt unter die Richtlinie 2014/65/EU
		FALSE	Wertpapierfirma fällt nicht unter die Richtlinie 2014/65/EU
6	Submitting entity identification code	Identifikationscode der einreichenden Einrichtung (LEI)	
7	Buyer identification code	INTC	Person ist unbekannt, muss noch am gleichen Tag nachgereicht werden
		LEI:	Angabe durch LEI
		CCPT:	Angabe durch CCPT
		CONCAT:	Angabe durch CONCAT
		NIDN:	Angabe durch NIDN
MIC:	Angabe durch MIC		
8	Country of the branch for the buyer	Geburtsland des Käufers	
9	Buyer - first name(s)	Vorname des Käufers	
10	Buyer - surname(s)	Nachname des Käufers	
11	Buyer - date of birth	Geburtsdatum des Käufers	
12	Buyer decision maker code	INTC	Person ist unbekannt, muss noch am gleichen Tag nachgereicht werden
		LEI:	Angabe durch LEI
		CCPT:	Angabe durch CCPT
		CONCAT:	Angabe durch CONCAT
		NIDN:	Angabe durch NIDN

13	Buy decision maker - First Name(s)	Vorname des Entscheidungsträgers, des Käufers	
14	Buy decision maker – Surname(s)	Nachname des Entscheidungsträgers, des Käufers	
15	Buy decision maker - Date of birth	Geburtsdatum des Entscheidungsträgers, des Käufers	
16	Seller identification code	INTC	Person ist unbekannt, muss noch am gleichen Tag nachgereicht werden
		LEI:	Angabe durch LEI
		CCPT:	Angabe durch CCPT
		CONCAT:	Angabe durch CONCAT
		NIDN:	Angabe durch NDIDN
		MIC:	Angabe durch MIC
17	Country of the branch for the seller	Geburtsland des Verkäufers	
18	Seller - first name(s)	Vorname des Verkäufers	
19	Seller - surname(s)	Nachname des Verkäufers	
20	Seller - date of birth	Geburtsdatum des Verkäufers	
21	Seller decision maker code	INTC	Person ist unbekannt, muss noch am gleichen Tag nachgereicht werden
		LEI:	Angabe durch LEI
		CCPT:	Angabe durch CCPT
		CONCAT:	Angabe durch CONCAT
		NIDN:	Angabe durch NDIDN
22	Seller decision maker - First Name(s)	Vorname des Entscheidungsträgers, des Verkäufers	
23	Seller decision maker – Surname(s)	Nachname des Entscheidungsträgers, des Verkäufers	
24	Seller decision maker - Date of birth	Geburtsdatum des Entscheidungsträgers, des Verkäufers	
25	Transmission of order indicator	TRUE	Dieser Auftrag ist übermittelt worden
		FALSE	Dieser Auftrag ist nicht übermittelt worden
26	Transmitting firm identification code for the buyer	LEI der übermittelnden Firma für den Käufer	
27	Transmitting firm identification code for the seller	LEI der übermittelnden Firma für den Verkäufer	
28	Trading date time	Datum und Uhrzeit wann die Transaktion ausgeführt wurde	
29	Trading capacity	DEAL	Handel für eigene Rechnung
		MTCH	Matched Principals
		AOTC	andere Kapazität
30	Quantity	UNT:	Angabe durch Stückzahl
		NOM:	Angabe durch Nomialwährung

		MON:	Angabe durch Gelder (Monetary)
31	Quantity currency	Währung der Menge	
32	Derivative notional increase/decrease	INCR	Erhöhung des Nominalbetrags des Derivats
		DECR	Verringerung des Nominalbetrags des Derivats
33	Price	PNDG	Preis ist noch unbekannt und muss später nachgereicht werden
		NOAP	Preis ist nicht zutreffend
		PC:	Angabe durch Prozentnotierung
		MV:	Angabe durch Währungspreis
		YLD:	Angabe durch Rendite (Yield)
		BP:	Angabe durch Basispunkte
34	Price Currency	Währung des Preises	
35	Net amount	Nettobetrag	
36	Venue	Handelsplatz	
37	Country of the branch membership	Land der Mitgliedschaft der Zweigniederlassung	
38	Up-front payment	Zahlung bei Abschluss	
39	Up-front payment currency	Währung der Zahlung bei Abschluss	
40	Complex trade component id	ID für Bestandteile eines komplexen Geschäfts	
41	Instrument identification code	Kennung des Finanzinstruments (ISIN)	
42	Instrument Full Name	Vollständige Bezeichnung des Instruments	
43	Instrument classification	Klassifizierung des Instruments (CFI-CODE)	
44	Notional currency 1	Nennwährung 1	
45	Notional currency 2	FX:	Angabe durch 'Foreign Exchange'
		INTRST:	Angabe durch 'Interest'
46	Price multiplier	Preismultiplikator	
47	Underlying instrument code	Code des Basisinstruments	
		SWAP:	Angabe durch Swap
		OTHR:	anderweitige Angabe
48	Underlying index name	Bezeichnung des Basisindexes	
49	Term of the underlying index	Laufzeit des Basisindexes	
		DAYS#	Angabe in Tagen
		WEEK#	Angabe in Wochen
		MNTH#	Angabe in Monaten
		YEAR#	Angabe in Jahren
48 - 49	Underlying instrument	Für diese Angabe muss Feld 47 mit einer Option befüllt sein. Es reicht die alleinige Option aus, falls keine ISINs angegeben werden.	
50	Option type	Art der Option	
		PUTO	Put
		CALL	Call

		OTHR	nicht ersichtlich ob Put oder Call
51	Strike price	Ausübungspreis	
		PNDG	Preis ist noch unbekannt und muss später nachgereicht werden
		NOAP	Preis ist nicht zutreffend
		PC:	Angabe durch Prozentnotierung
		MV:	Angabe durch Währungspreis
		YLD:	Angabe durch Rendite (Yield)
		BP:	Angabe durch Basispunkte
52	Strike price currency	Währung des Ausübungspreises	
53	Option exercise style	Art der Option (mögliche Ausübung)	
		EURO	European
		AMER	American
		ASIA	Asian
		BERM	Bermudan
		OTHR	alle anderen Typen
54	Maturity date	Fälligkeitstermin	
55	Expiry date	Ablaufdatum	
56	Delivery type	Art der Lieferung	
		PHYS	Physically settled
		CASH	Cash settled
		OPTL	Optional for counterparty or when determined by a third party
57	Investment decision within firm	Anlageentscheidung innerhalb der Firma	
		LEI:	Angabe durch LEI
		CCPT:	Angabe durch CCPT
		CONCAT:	Angabe durch CONCAT
		NIDN:	Angabe durch NIDN
		NORE	Entscheidung wurde außerhalb der Firma getroffen
58	Country of the branch responsible for the person making the investment decision	Land der Zweigniederlassung, die für die Person verantwortlich ist, die die Anlageentscheidung trifft	
59	Execution within firm	Ausführung innerhalb der Firma	
		LEI:	Angabe durch LEI
		CCPT:	Angabe durch CCPT
		CONCAT:	Angabe durch CONCAT
		NIDN:	Angabe durch NIDN
		NORE	Entscheidung wurde außerhalb der Firma getroffen

60	Country of the branch supervising the person responsible for the execution	Land der Zweigniederlassung, die die Aufsichtsverantwortung für die für die Ausführung verantwortliche Person hat	
61	Waiver indicator	Ausnahmeindikator	
		RFPT	Reference price
		NLIQ	Negotiated (liquid)
		OILQ	Negotiated (illiquid)
		PRIC	Negotiated (conditions)
		ILQD	Illiquid instrument
62	Short selling indicator	Leerverkaufs-indikator	
		SESH	Short sale with no exemption
		SSEX	Short sale with exemption
		SELL	No short sale
63	OTC post-trade indicator	Leerverkaufs-indikator	
		UNDI	Information not available
		OTC-Nachhandelsindikator	
		BENC	Benchmark
		ACTX	Agency cross
		LRGS	Large in scale
		ILQD	Illiquid instrument
		SIZE	Above specified size
		CANC	Cancellations
		AMND	Amendments
		SDIV	Special dividend
		PRIC	Price improvement
		DUPL	Duplicative
		TNCP	Not contributing to the price discovery process
TPAC	Package		
XFPH	Exchange for Physical		
64	Commodity derivative indicator	Indikator für Warenderivate	
		TRUE	Warenderivat
		FALSE	kein Warenderivat
65	Securities financing transaction indicator	TRUE	SFT
		FALSE	kein SFT

Weitere Informationen zur Befüllung ist den beigelegten Regulatorik-Dokumenten zu entnehmen.

Referenzen Regulatorik

2016-1521_mifir_transaction_reporting_technical_reporting_instructions.pdf (Stand 09.03.2018)

<https://www.google.de/search?q=2016-1521+mifir+transaction+reporting+technical+reporting+instructions&oq=2016-1521+mifir+transaction+reporting+technical+reporting+instructions&aqs=chrome..69i57j69i60.1182j0j7&sourceid=chrome&ie=UTF-8>

2017__590 DV_Meldung_von_Geschaeften.pdf (ab Seite 453, Stand 09.03.2018)

<http://eur-lex.europa.eu/legal-content/DE/TXT/PDF/?uri=OJ:L:2017:087:FULL&from=DE>

esma-2016-1452_guidelines_mifid_ii_transaction_reporting_de.pdf (Stand 09.03.2018)

https://kpmg-lexlinks.de/fileadmin/Externe_Dokumente/Kreditinstitute/EU/MiFIR/Amtsblatt/Guidelines/ESMA-MiFIRMiFIDII-GL-2016-1452_Meldung_von_Geschaeften.pdf

2016-1521_annex_1_mifir_transaction_reporting_validation_rules.xlsx (Stand 09.03.2018)

https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2016-1521_annex_1_mifir_transaction_reporting_validation_rules.xlsx

Hinweise

Der Nutzer ist selbst für die Inhalte der Meldung verantwortlich. Der Programmhersteller übernimmt keine Haftung oder Gewährleistung für die erfolgreiche Übermittlung.

Der Programmhersteller haftet nicht für Schäden an Soft- oder Hardware oder Vermögensschäden, die durch das Benutzen des Programms entstehen. Der Benutzer ist selber dafür verantwortlich, die gemeldeten Transaktionsdaten zu überprüfen und die Antwort der BaFin (z.B. Log-Dateien) zu kontrollieren.

Der Softwarehersteller sichert keine Eigenschaften oder Funktionen zu, die nicht in diesem Handbuch beschrieben sind.

Das MiFIR-Meldetool nutzt Softwarekomponenten von Fremdherstellern (z.B. Open-Source Komponenten), die in den Lizenzbedingungen einzeln aufgeführt sind.

Änderungshistorie

180309

- Feld „Price“ wurde vom Format „DECIMAL-18/5“ auf „DECIMAL-18/17“ geändert.
- Zellenübergreifender Validator beigefügt. Dieser validiert ausgehend vom Eintrag einer Zelle, die Einträge anderer Zellen auf fachliche Korrektheit, z.B.: „Maturity Date“ muss später liegen als „Trading Date“ oder bei Eingabe des CFI – Codes SXXXXX muss ein Swap als „Underlying Instrument“ angegeben werden.

180124

- „Account Owner“ und „Decision Maker“ können nun mit mehr als nur einer Person eingetragen werden.
- Felder „Up-front payment“, „Up-front payment currency“ und „Complex trade component id“ können nun eingetragen werden.
- Felder 42 – 56 können nun befüllt werden. Dies sind Zusatzinformationen zu den Wertpapieren.
- Feld „Waiver indicator“ und Feld „OTC post-trade indicator“ können nun mit mehreren Daten eingetragen werden.

180117

- Abhängigkeiten wurden weiter aufgeräumt.
- Vor dem Konvertieren wird, falls bereits vorhanden, die Ziel XML Datei gelöscht, so kann bei fehlerhaften Konvertieren schwerer ein falscher Report gesendet werden.
- Konverter nutzt strengere Validierung:
 - Stimmt eine Zelle innerhalb einer Zeile nicht, wird nicht konvertiert.
 - Es werden nur Zellen vorvalidiert, wenn etwas eingetragen wurde.
 - Vorvalidierung passiert vor dem Konvertieren einer einzelnen Zeile, bei Fehler werden alle fehlerhaften Zellen protokolliert.

180112

- BafinSender.jar und BafinConverter.jar sind in art26melder.jar zusammengefasst worden.
- Die Sende-Funktion wird nun mit der Option „-s“ und Converter-Funktion mit der Option „-c“ aufgerufen (siehe Beispielaufrufe).
- Unnötige Abhängigkeiten von Fremdkomponenten wurden entfernt.
- Feld[57] muss nun mit folgenden Optionen ausgestattet werden: CONCAT, NIDN, CCPT, ALGO.
- Feld[59] muss nun mit folgenden Optionen ausgestattet werden: CONCAT, NIDN, CCPT, ALGO, NORE.
- Inkonsistenz der Zahleneingabe wurde behoben: Als Trennzeichen wird Punkt statt Komma genutzt. Zahlen dürfen kein Komma enthalten.

171227

- Feld[1] ReportStatus wird nun verwendet.
- NEW für eine neue Transaktionsmeldung und CXL zum Stornieren einer Meldung

171222

- Der Identification Code des Account Owners [7|16] muss mit den Optionen MIC, LEI, CONCAT, NIDN oder CCPT genutzt werden.
- Der Identification Code des Decision Makers [12|21] muss mit den Optionen LEI, CONCAT, NIDN oder CCPT genutzt werden.
- Der Price [33|51] ist nun mit den Optionen PNDG, NOAP, PC, MV, YLD, BP einzugeben.
- Die Quantity [30] ist nun mit den Optionen UNT, NOM, MON einzugeben.
- Beispiele für die neuen Optionen wurden in das Excel Template beigefügt (unter dem Worksheet Referenzen).
- Falls Reihen in der Konvertierung bereits rausgefiltert werden, weil Informationen fehlerhaft sind, wird dennoch ein Report gesendet. Dieser Report beinhaltet nur Reihen, welche beim Parsen akzeptiert wurden. Ein Bericht über fehlerhafte Reihen wird nach dem Senden dem Nutzer angezeigt.