

MiFIR – Meldetool Benutzerhandbuch



Inhaltsverzeichnis

Inhaltsverzeichnis	2
Einleitung	4
Handhabungskonzept	4
Eintragen der Daten	4
MiFIR – Meldetool Programm	4
Template Vorlage	4
Konfiguration	4
Aufsichtsbehörde Deutschland: BaFin und MVP - Portal	4
Aufsichtsbehörde Liechtenstein: FMA	5
Backups	5
Systemumgebung	5
Konfiguration	6
Konfiguration BaFin	7
Konfiguration FMA	7
Konfigurationsübersicht	8
Programmnutzung	9
Programmaufruf	9
Optionen	9
Konfigurationsdateien	10
Converter.conf	10
Bafin.conf	11
ConverterFMA.conf	14
FMA.conf	15
Template Nutzung	17
Import Format Excel	17
Import Format.csv	17
Spalteninhalte Import (.csv und Excel)	17
Zellvalidierung	22
Referenzen Regulatorik	27
Hinweise	27
MiFIR Meldetool Fehlerquellen	27
Pflichtfelder	27

Stornierung einer Transaktion	28
Sonderzeichen & Umlaute	28
Feld 2 "Transaction Reference Number"	28
Datum	28
Feld 28 "Trading date time"	29
Feld 29 "Trading capacity"	29
Feld 52 "Strike price currency"	29
LEI	29
Concat	29
Hinweise der BaFin	30
Feld 4 "Executing entity identification Code"	30
Feld 5 "Investment Firm covered by Directive 2014/65/EU"	30
Felder 7 bis 24 "Beteiligte"	30
Country of branch	31
Feld 25 "Transmission of order indicator"	31
Feld 29 "Trading capacity"	32
Feld 33 "Price"	32
Feld 36 "Venue"	32
Feld 37 "Country of the branch Membership"	32
Hinweis zu MVP Feedback-files:	32
Änderungshistorie	34
180601	34
180509	34
180124	34
180117	35
180112	35
171227	35
171220	35

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 / CSV Template in die XML – Zielstruktur
- 2) Uploader: Sendet die XML – Zielstruktur an die BaFin / FMA

Es handelt sich bei diesem Tool um ein Java Programm. Das Programm kann entweder direkt über die Kommandozeile oder mit Doppelklick auf die vorbereiteten BAT – Dateien ausgeführt werden. Der Sender für FMA nutzt zusätzlich ein C# Programm.

Template Vorlage

Die Template – Vorlage dient der Erfassung einzelner Felder für Transaktionsmeldungen. Die hier eingetragenen Informationen können anschließend in das XML – Zielformat konvertiert und an die BaFin oder FMA gesendet werden (mehr dazu in „Template Nutzung“).

Konfiguration

Das Programm besitzt jeweils zwei Konfigurationsdateien pro Aufsichtsbehörde:

„Bafin_UploadAndDownloadProtokoll.conf“ sowie „Bafin_Converter.conf“ für das Melden an die BaFin und „FMA_UploadAndDownloadProtokoll.conf“ und „FMA_Converter.conf“ für das Melden an die FMA.

Diese Dateien konfigurieren jeweils einen Teil des MiFIR – Meldetools. Mehr dazu in der Konfigurationsübersicht.

Aufsichtsbehörde Deutschland: 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 „Protokoll einsehen“ sind alle Meldungen und deren Status vorzufinden.

Aufsichtsbehörde Liechtenstein: FMA

Zum Melden an die FMA werden Autorisierungszertifikate der FMA benötigt. Diese können dem e-Service der FMA entnommen werden. Weiter Informationen finden Sie dazu unter <https://www.fma.li/files/list/wl-19-2017-de-final.pdf> ab Seite 19ff „5.2 Verteilung der Legitimationsmittle über das e-Service Portal“. Dieses Dokument ist auch unter \Regulatorik\wegleitung-trem-clean-.pdf vorzufinden. Eine Anleitung zur Installation der Autorisierungszertifikate finden Sie im gleichen Dokument ab Seite 4ff „1.1.4 Web Service Security“ mit dem Unterschied, dass die Zertifikate im Speicherort „Aktueller Benutzer“ statt „Lokaler Computer“ erwartet werden.

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:

Entfernen des Texts: „jre1.8.0_131\bin\“ aus den BAT – Dateien.









Konfiguration

Nachdem Sie die gelieferte Datei des MiFIR – Meldetools entpackt haben, finden Sie folgendes Verzeichnis vor (Versionsnummer kann variieren):











\MiFirMelder180601\

-  BaFin
-  dependency-jars
-  Dokumentation
-  FMA
-  jre1.8.0_131
-  art26melder.jar

\MiFirMelder180601\BaFin\

-  Protokoll
-  Bafin_ConvertAndUpload.bat
-  Bafin_Converter.bat
-  Bafin_Converter.conf
-  Bafin_DownloadProtokoll.bat
-  Bafin_Template.xlsx
-  Bafin_Upload.bat
-  Bafin_UploadAndDownloadProtokoll.conf

\MiFirMelder180601\FMA\

-  Protokoll
-  Resources_FMA
-  FMA_ConvertAndUpload.bat
-  FMA_Converter.bat
-  FMA_Converter.conf
-  FMA_DownloadProtokoll.bat
-  FMA_Template.xlsx
-  FMA_TestConnection.bat
-  FMA_Upload.bat
-  FMA_UploadAndDownloadProtokoll.conf

Konfiguration BaFin

Öffnen Sie die Datei **Bafin_UploadAndDownloadProtokoll.conf** (diese wird benötigt um an die BaFin zu melden):

Die mit gelb markierten Stellen sind zu befüllen. Ein Beispiel:

```
{
  "username": "max.muster90865",
  "password": "Passwort123",
  "usertoken": "hg_07_1234",
  "xmlPath": "A26MiFIR_12345678912345678912_Report.xml",
  "test": true,
  "archive": "Protokoll/RueckmeldungBafin",
  "search": "protokoll",
  "meldezeitpunktVon": "DAY:0",
  "verfahrenId": [ "A_26_MI_FIR", "T_A_26_MI_FIR" ]
}
```

Öffnen Sie die Datei **Bafin_Converter.conf**:

Die mit gelb markierten Stellen sind zu befüllen. Ein Beispiel:

```
{
  "dataPath": "Template.xlsx",
  "xmlDestination": "A26MiFIR_98765432109876543210_Report.xml",
  "fromLEI": "98765432109876543210",
  "toCc": "DE",
  "allowRowValidation": true,
  "allowCellValidation": true,
  "seqNum": 0
}
```

Konfiguration FMA

Öffnen Sie die Datei **FMA_Converter.conf**. Diese Konfigurationsdatei dient der Konvertierung für die FMA Liechtenstein. Es handelt sich um die gleiche Konfigurationsdatei wie Converter.conf, mit dem Unterschied, dass der Parameter „toCc“ auf LI gesetzt ist:

```
{
  "dataPath": "Template.xlsx",
  "xmlDestination": "A26MiFIR_98765432109876543210_Report.xml",
  "fromLEI": "98765432109876543210",
  "toCc": "LI",
  "allowRowValidation": true,
  "allowCellValidation": true,
  "seqNum": 3
}
```

Öffnen Sie die Datei **FMA_UploadAndDownloadProtokoll.conf** (diese wird benötigt um an die FMA zu melden):

Die mit gelb markierten Stellen sind zu befüllen. Ein Beispiel:

```
{
  "cliPath": "Resources_FMA/Test/DRICLI.exe",
  "transactionReportPath": "A26MiFIR_98765432109876543210_Report.xml",
  "downloadPath": "Protokoll/RueckmeldungFMA",
  "meldungId": [983],
  "leiCode": "98765432109876543210"
}
```

Konfigurationsübersicht

Datei / Pfad	Funktion
\MiFirMelder180601\	
art26Melder.jar	Konvertierung Excel zu ISO-20022 XML Format + Konvertierung CSV zu ISO-20022 XML Format + Melden von Transaktionen an BaFin + Melden von Transaktionen an FMA + Download von Feedback zu Transaktionsmeldung BaFin + Download von Feedback zu Transaktionsmeldung FMA + Verbindungstest zu FMA
BaFin	BaFin Verzeichnis
FMA	FMA Verzeichnis
\jre1.8.0_131\	Java Runtime Engine
\dependency-jars\	Verwendete Programmbibliotheken
\Dokumentation\	Verzeichnis mit Regulatorik und Dokumentation
\MiFirMelder180601\BaFin\	
\Protokoll\	Protokoll Verzeichnis, Standort für Logfile und Speicherort des Feedbacks der Transaktionsmeldungen
Bafin_Converter.bat	Aufruf art26melder.jar als Konverter
Bafin_Upload.bat	Aufruf art26melder.jar als Sender an BaFin
Bafin_ConvertAndUpload.bat	Aufruf art26melder.jar als Konverter + Aufruf art26melder.jar als Sender an BaFin
Bafin_DownloadProtokoll.bat	Aufruf art26melder.jar als Protokoll Download von BaFin
Bafin_Converter.conf	Konfigurationsparameter für Converter Funktionalität
Bafin_UploadAndDownloadProtokoll.conf	Konfigurationsparameter für BaFin Funktionalität, Upload Meldung & Download Feedback
Bafin_Template.xlsx	Excel Template
\MiFirMelder180601\FMA \	
\Protokoll\	Protokoll Verzeichnis, Standort für Logfile und Speicherort des Feedbacks der Transaktionsmeldungen
\Resources_FMA\	C# Hilfsprogramm zum Senden an die FMA
FMA_Converter.bat	Aufruf art26melder.jar als Konverter
FMA_Upload.bat	Aufruf art26melder.jar als Sender an FMA
FMA_ConvertAndUpload.bat	Aufruf art26melder.jar als Konverter + Aufruf art26melder.jar als Sender an FMA
FMA_DownloadProtokoll.bat	Aufruf art26melder.jar als Protokoll Download von FMA
FMA_Converter.conf	Konfigurationsparameter für Converter Funktionalität
FMA_UploadAndDownloadProtokoll.conf	Konfigurationsparameter für FMA Funktionalität, Upload Meldung & Download Feedback

FMA_TestConnection.bat	Aufruf art26melder.jar als Verbindungstest an FMA
FMA_Template.xlsx	Excel Template

Programmnutzung

Im folgendem Abschnitt wird erläutert wie das MiFIR – Meldetool aufgerufen wird. Es werden alle vorhandenen Funktionalitäten mit Bezug auf die passenden Konfigurationsdaten erklärt.

Programmaufruf

Der Aufruf des MiFIR – Meldetools hat folgendes Schema:

```
..\jre.1.8.0_131\bin\java -jar ..\Art26Melder.jar -Option Konfigurationsdatei
```

„jre.1.8.0_131\bin\java -jar“ -> Aufruf des Java – Programms
 „Art26Melder.jar“ -> Java Programmdatei
 „-Option“ -> Auswahl der auszuführenden Funktion
 „Konfigurationsdatei“ -> Passende Konfigurationsdatei zur Option

Optionen

Das MiFIR – Meldetool bündelt mehrere Funktionalitäten unter einem Programm. Um diese gezielt anzusteuern erwartet das Programm eine Option und Konfigurationsdatei als Argument.

Option	Konfigurationsdatei	Beschreibung
-c	X_Converter.conf	Konvertierung einer Excel oder CSX Datei in ISO – 20022 XML Das X steht für die Aufsichtsbehörde (Bafin FMA)
-bs	Bafin_UploadAndDownloadProtokoll.conf	Senden der Transaktionsmeldung an die BaFin
-bp	Bafin_UploadAndDownloadProtokoll.conf	Download: Rückmeldungen zu Transaktionsmeldungen von BaFin
-fs	FMA_UploadAndDownloadProtokoll.conf	Senden der Transaktionsmeldung an die FMA
-fp	FMA_UploadAndDownloadProtokoll.conf	Download: Rückmeldungen zu Transaktionsmeldungen von FMA
-fct	FMA_UploadAndDownloadProtokoll.conf	Verbindungstest: FMA

Konfigurationsdateien

In diesem Abschnitt werden alle Konfigurationsdateien erläutert und erklärt wie diese in Kombination mit den Optionen zu nutzen sind.

Converter.conf

```
{
  "dataPath": "Template.xlsx",
  "xmlDestination": "A26MiFIR_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX_Report.xml",
  "fromLEI": "XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX",
  "toCc": "DE",
  "allowRowValidation": true,
  "allowCellValidation": true,
  "seqNum": 5
}
```

Parameter

Parameter	Beschreibung
dataPath	Verzeichnis und Name der ImportExcel-Tabelle / ImportCSV-Tabelle Erwartet: Dateiverzeichnis mit Namen der Datei
xmlDestination	Ziel-Verzeichnis und Name der generierten XML-Datei Erwartet: Dateiverzeichnis mit Namen der Datei
fromLEI	LEI als Sender-Referenz Erwartet: LEI [18 Buchstaben Zahlen + 2 Zahlen]

Optionale Parameter

Parameter	Default	Beschreibung
toCc	“DE“	Welche Aufsichtsbehörde empfängt die Meldung Erwartet: Ländercode [2 Buchstaben]
allowRowValidation	true	Aktiviere Validierung der gesamten Reihe Erwartet: [true false]
allowCellValidation	true	Aktiviere Validierung der einzelnen Zellen Erwartet: [true false]
seqNum	0	Führt eine fortlaufende Referenznummer zu jeder Konvertierung Erwartet: Nummer

Konvertierung einer Excel Datei in das ISO – 20022 XML Format

Programmaufruf: Art26Melder.jar

Beispielaufruf

```
..\jre1.8.0_131\bin\java -jar ..\Art26Melder.jar -c Bafin_Converter.conf
```

Parameter

- ..\jre1.8.0_131\bin\java Verwendete Java Runtime (optional)
- -jar Aufruf einer Java Datei
- ..\art26melder.jar Programmdatei
- -c Programmoption „Converter“
- Bafin_Converter.conf Name der Konfigurationsdatei

Bafin_UploadAndDownloadProtokoll.conf

```
{
  "username": "",
  "password": "",
  "usertoken": "",
  "xmlPath": "A26MiFIR_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX_Report.xml",
  "test": true,
  "archive": "Protokoll/RueckmeldungBafin",
  "search" : "protokoll",
  "meldezeitpunktVon" : "DAY:-1",
  "verfahrenId" : [ "A_26_MI_FIR", "T_A_26_MI_FIR" ]
}
```

Parameter BafinUpload

Zum Senden einer Transaktionsmeldung, an die BaFin, werden folgende Parameter benötigt:

Parameter	Beschreibung
username	MVP – Portal Login Name
	Erwartet: String
password	MVP – Portal Login Password
	Erwartet: String
usertoken	MVP – Portal Token zum passenden Verfahren
	Erwartet: String
xmlPath	Einzureichende Transaktionsmeldung
	Erwartet: Dateiverzeichnis mit Namen der Datei
Test	Bei „true“ wird an das Testverfahren gemeldet, bei „false“ an Produktiv
	Erwartet: [true false]

Parameter BafinDownloadProtokoll

Parameter	Beschreibung
username	MVP – Portal Login Name
	Erwartet: String
password	MVP – Portal Login Password
	Erwartet: String
archive	Ordnerpfad zum Archivieren von Rückmeldungen der BaFin
	Erwartet: Dateiverzeichnis
search	Steuerung des Endpunkts, Erwartet: [rueckmeldung protokoll]
	Für einzelne Rückmeldungen ist „rueckmeldung“ auszuwählen.
	Von den folgenden Parametern unten wird <u>nur meldungId</u> berücksichtigt.
	Für eine Suche im BaFin Protokoll – Verzeichnis ist „protokoll“ auszuwählen.
meldungId	Führt zuerst eine Suche im Protokoll nach allen Meldungen, welche mit den unten angegeben Parametern übereinstimmen, sammelt und anschließend über die Funktion „rueckmeldung“ runterlädt.
	Alle unteren Parameter sind <u>Optional</u> zu benutzen.
	Identifikationsnummern der gesendeten Transaktionsmeldungen
meldezeitpunktVon	Erwartet: Array von Zahlen
	Startzeitpunkt der Meldung. Erwartet: Timestamp Zeitpunktoption

	<i>Timestamp</i> Format: yyyy-MM-dd yyyy-MM-dd HH:mm:ss Beispiel: 2018-05-22 2018-05-22 14:30:52	
	<i>Zeitpunktoption</i> Format: [DAY MONTH YEAR]:Nummer → Addiert die Zahl auf das heutige Datum mit der Uhrzeit 00:00:00 Beispiel: "DAY:-1" oder "MONTH:+2"	
meldezeitpunktBis	Endzeitpunkt der Meldung.	Erwartet: Timestamp Zeitpunktoption (siehe meldezeitpunktVon)
verfahrenId	Filter für Verfahren	Erwartet: Array von VerfahrenIdType
haftungsgeberId	Filter für Haftungsgeber	Erwartet: Array von HaftungsgeberId
einreichungId	Filter für Einreichung	Erwartet: Array von EinreichungIdType
statusId	Filter für Status	Erwartet: Array von StatusIdType
meldeweg	Filter für Melde Weg	Erwartet: Array von MeldewegIdType
dateiname	Filter für Dateinamen	Erwartet: Array von Dateinamen
kundenreferenz	Filter für Kundenreferenz	Erwartet: Array von Kundenreferenz

VerfahrenIdType: Davon ist „A_26_MI_FIR“ für Produktivmeldungen und „T_A_26_MI_FIR“ für Testmeldungen.

EinreichungIdType: Davon ist „A_26_MI_FIR“ für Produktivmeldungen.

StatusIdType: [ACCEPTED, COMPLETED, PRELIMINARY, PROCESSING, PROCESSING_OFFSITE, REJECTED_CONTENT, REJECTED_NOTIFIER, REJECTED_PRELIMINARY, SUBMITTED]

MeldewegIdType: [FMS, WS, WS_CP, WS_MTOM, XML_UPLOAD]

Melden der XML Datei an das BaFin MVP Portal

Programmaufruf: Art26Melder.jar

Beispielaufruf: BaFin

```
..\jre1.8.0_131\bin\java -jar ..\Art26Melder.jar -bs Bafin_UploadAndDownloadProtokoll.conf
```

Parameter







- ..\jre1.8.0_131\bin\java Verwendete Java Runtime (optional)
- -jar Aufruf einer Java Datei
- ..\art26melder.jar Programmdatei
- -bs Programmoption: „Senden“
- Bafin_UploadAndDownloadProtokoll.conf Name der Konfigurationsdatei

Protokolldatei: MiFIR_MeldeTool.log

```
2018-06-21 17:09:01 - INFO : Programm: Start.
2018-06-21 17:09:01 - INFO : Option: Bafin Sender.
2018-06-21 17:09:04 - INFO : Creating Service {http://www.bafin.de/mvp/a26mifir/}MVP_A26MiFIR
2018-06-21 17:09:05 - INFO : Testbericht
2018-06-21 17:09:05 - INFO : File: A26MiFIR_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX_Report.xml
2018-06-21 17:09:06 - INFO : Erfolgreiche Meldung: 2018-06-21T15:09:04.853Z -> 7378132, null
2018-06-21 17:09:06 - INFO : Programm: Ende. 0
```

Ausführen von BafinDownloadProtokoll.bat mit „meldezeitpunktVon“

Durch das Ausführen werden alle Protokolle der Transaktionsmeldungen am angegebenen Tag heruntergeladen. Diese befinden sich danach unter \Protokoll\RueckmeldungBafin.

 7372731_DE_FDBTRA_XB_017117_18.xml	21.06.2018 17:12	XML-Dokument	2 KB
 7372990_DE_FDBTRA_XB_017119_18.xml	21.06.2018 17:12	XML-Dokument	2 KB
 7375705_DE_FDBTRA_XB_017133_18.xml	21.06.2018 17:12	XML-Dokument	2 KB
 7377799_DE_FDBTRA_XB_017146_18.xml	21.06.2018 17:12	XML-Dokument	2 KB
 Response_SucheMvpProtokoll.xml	21.06.2018 17:12	XML-Dokument	9 KB
 Response_SucheMvpRueckmeldung_0.xml	21.06.2018 17:12	XML-Dokument	5 KB

In dem markierten Dokument befinden sich alle Transaktionen nach Transaktions-ID sortiert.

Ausführen von BafinDownloadProtokoll.bat mit „meldungId“

Neben der Möglichkeit die Protokolle nach Datum abzurufen, gibt es auch die Möglichkeit sie nach ihrer Meldungs-ID abzurufen. Diese ID ist in der LOG-Datei vermerkt.

```
2018-06-21 17:09:01 - INFO : Programm: Start.
2018-06-21 17:09:01 - INFO : Option: Bafin Sender.
2018-06-21 17:09:04 - INFO : Creating Service {http://www.bafin.de/mvp/a26mifir/}MVP_A26MiFIR
2018-06-21 17:09:05 - INFO : Testbericht
2018-06-21 17:09:05 - INFO : File: A26MiFIR_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX_Report.xml
2018-06-21 17:09:06 - INFO : Erfolgreiche Meldung: 2018-06-21T15:09:04.853Z -> 7378132, null
2018-06-21 17:09:06 - INFO : Programm: Ende. 0
```

Um das Protokoll mit der ID abzufragen, muss zuerst der Parameter „meldezeitpunktVon“ in der Config Datei „Bafin_UploadAndDownloadProtokoll.conf“ zu „meldungId“ geändert werden. Hier wird nun in eckigen Klammern ohne Anführungszeichen die Transaktionsnummer eingetragen. Außerdem muss bei search „rueckmeldung“ eingetragen werden.

```
"meldungId" : [7378132],
```

Wenn man nun BafinDownloadProtokoll.bat ausführt, wird das Protokoll mit der oben genutzten Meldungs-ID in den Ordner \Protokoll\RueckmeldungBafin heruntergeladen.

FMA_Converter.conf

```
{
  "dataPath": "Template.xlsx",
  "xmlDestination": "A26MiFIR_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX_Report.xml",
  "fromLEI": "XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX",
  "toCc": "DE",
  "allowRowValidation": true,
  "allowCellValidation": true,
  "seqNum": 7
}
```

Parameter

Parameter	Beschreibung
dataPath	Verzeichnis und Name der ImportExcel-Tabelle / ImportCSV-Tabelle Erwartet: Dateiverzeichnis mit Namen der Datei
xmlDestination	Ziel-Verzeichnis und Name der generierten XML-Datei Erwartet: Dateiverzeichnis mit Namen der Datei
fromLEI	LEI als Sender-Referenz Erwartet: LEI [18 Buchstaben Zahlen + 2 Zahlen]

Optionale Parameter

Parameter	Default	Beschreibung
toCc	"LI"	Welche Aufsichtsbehörde empfängt die Meldung Erwartet: Ländercode [2 Buchstaben]
allowRowValidation	true	Aktiviere Validierung der gesamten Reihe Erwartet: [true false]
allowCellValidation	true	Aktiviere Validierung der einzelnen Zellen Erwartet: [true false]
seqNum	0	Führt eine fortlaufende Referenznummer zu jeder Konvertierung Erwartet: Nummer

Konvertierung einer Excel Datei in das ISO – 20022 XML Format

Programmaufruf: Art26Melder.jar

Beispielaufruf

```
..\jre1.8.0_131\bin\java -jar ..\Art26Melder.jar -c FMA_Converter.conf
```

Parameter

- ..\jre1.8.0_131\bin\java Verwendete Java Runtime (optional)
- -jar Aufruf einer Java Datei
- ..\art26melder.jar Programmdatei
- -c Programmoption „Converter“
- FMA_Converter.conf Name der Konfigurationsdatei

FMA_UploadAndDownloadProtokoll.conf

```
{
  "cliPath": "Resources_FMA/Test/DRICLI.exe",
  "transactionReportPath": "A26MiFIR_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX_Report.xml",
  "downloadPath": "Protokoll/RueckmeldungFMA",
  "date": "DAY:-1",
  "leiCode": "XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX"
}
```

Parameter FMA_UploadAndDownloadProtokoll.conf

Parameter	Beschreibung
cliPath	Pfad des C# Hilfsprogramms
	Erwartet: Dateiverzeichnis mit Namen der Datei Testmeldung: "Resources_FMA/Test/DRICLI.exe" Produktivmeldung: "Resources_FMA/Produktiv/DRICLI.exe"
transactionReportPath	Einzureichende Transaktionsmeldung Erwartet: Dateiverzeichnis mit Namen der Datei
downloadPath	Ordnerpfad zum Archivieren von Rückmeldungen der FMA
	Erwartet: Dateiverzeichnis
date	Tag der Transaktionsmeldung (zum Abholen des Protokolls)
	Erwartet: Timestamp Zeitpunktoption (<i>siehe meldezeitpunktVon</i> , unter Bafin.conf)
leiCode	LEI als Sender-Referenz
	Erwartet: LEI [18 Buchstaben Zahlen + 2 Zahlen]

Melden der XML Datei an die FMA und Download des Protokolls

Programmaufruf: Art26Melder.jar

Beispielaufruf: FMA

```
..\jre1.8.0_131\bin\java -jar ..\Art26Melder.jar -fs FMA_UploadAndDownloadProtokoll.conf
```

Parameter

- ..\jre1.8.0_131\bin\java Verwendete Java Runtime (optional)
- -jar Aufruf einer Java Datei
- ..\art26melder.jar Programmdatei
- -s Programmoption: „Senden“
- FMA_UploadAndDownloadProtokoll.conf Name der Konfigurationsdatei

Konfigurationsdatei: FMA_UploadAndDownloadProtokoll.conf

```
{
  "cliPath": "Resources_FMA/Test/DRICLI.exe",
  "transactionReportPath": "A26MiFIR_529900UHDH7QLRMEJQ86_Report.xml",
  "downloadPath": "Protokoll/RueckmeldungFMA",
  "date": "2018-06-06",
  "leiCode": "529900UHDH7QLRMEJQ86"
}
```

Parameter

- cliPath: Pfad zum C# Hilfsprogramm
- transactionReportPath Pfad zur XML – Meldedatei
- downloadPath gibt an wo das Protokoll gespeichert wird
- date über diesen Parameter wird bestimmt welche Protokolle abgerufen werden sollen
- leiCode: LEI des Melders

Protokolldatei: MiFIR_MeldeTool.log

```
2018-05-23 17:02:47 - INFO : Programm: Start.
2018-05-23 17:02:47 - INFO : Option: FMA Sender.
2018-05-23 17:02:47 - INFO : Uploading A26MiFIR_XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX_Report.xml
2018-05-23 17:02:47 - INFO : Upload Transaction Report: Successfully submitted file. Further Vali
2018-05-23 17:02:47 - INFO : DRICLI Terminated...
2018-05-23 17:02:47 - INFO : Programm: Ende. 0
```

Ausführen von FmaDownloadProtokoll.bat mit „Date“

Es gibt zwei Möglichkeiten den Parameter Date zu befüllen, Möglichkeit ist „date“: „-1“ z.B für gestern oder anstelle der -1 ein Datum der Form „YYYY-MM-DD“ einzutragen.

```
{
  "cliPath": "Resources_FMA/Test/DRICLI.exe",
  "transactionReportPath": "A26MiFIR_529900UHDH7QLRMEJQ86_Report.xml",
  "downloadPath": "Protokoll/RueckmeldungFMA",
  "date": "2018-06-06",
  "leiCode": "529900UHDH7QLRMEJQ86"
}
```

Wenn man nun FmaDownloadProtokoll.bat ausführt, werden alle Protokolle mit dem oben angegebenen Datum in den Ordner \Protokoll\RueckmeldungFma heruntergeladen.

Wichtig: Das Datum des Feedbacks richtet sich nicht nach dem Einreichdatum, sondern nach dem Datum der Veröffentlichung des Feedbacks.

Template Nutzung

Import Format Excel

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.

Import Format.csv

Die erste Zeile des csv Formats enthält eine Überschrift oder Feldbeschreibungen. Diese Zeile wird vom Konverter ignoriert.

Eine Zeile enthält 65 Spalten getrennt durch pipe |. Ist die Anzahl der Spalten nicht 65, so gilt die Zeile als fehlerhaft. Die csv Datei wird im UTF8 Format erwartet.

Eigenschaften csv

- Trennzeichen: pipe – Beispiel: „|“
- Timestamp: Beispiel: „2018-03-22T14:40:00Z“ (z.B. „Trading date time“)
- Datumsformat: Beispiel: 2018-03-22 (z.B. „date of birth“)
- Zeilenwechsel über „\n“ (OD0A)
- Trennzeichen für Dezimalwerte ist der Punkt „.“.

Spalteninhalte Import (.csv und Excel)

Feld	Name	Regel	
		Auswahl	Bedeutung
1	Report Status	NEW	neue Transaktion
		CXL	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 NDIDN
		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 NDIDN
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
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
		Beispiele: SWAP: +{0: DE000A2DASD4,AT0000A1AWE4};-{0: BG11FOKAAT18} oder OTHR: {0: AT0000A1KVF2}	
48	Underlying index name	Bezeichnung des Basisindexes (*)	
		Beispiele: bei Swap: +{0:DAX 30};-{0:IBEX 35} bei OTHR: {0:DAX 30}	
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
Beispiele: bei Swap: +{0:MNTH#3};-{0: MNTH#3} bei OTHR: {0: MNTH#3}			
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	
		CCPT:	Angabe durch CCPT
		CONCAT:	Angabe durch CONCAT
		NIDN:	Angabe durch NDIDN
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	
		CCPT:	Angabe durch CCPT
		CONCAT:	Angabe durch CONCAT
		NIDN:	Angabe durch NDIDN
		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)
		SIZE	Above specified size
		ILQD	Illiquid instrument
62	Short selling indicator	Leerverkaufs-indikator	
		SESH	Short sale with no exemption
		SSEX	Short sale with exemption
		SELL	No short sale
		UNDI	Information not available
63	OTC post-trade indicator	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.

(*) Felder 47, 48 und 49 werden mit Indizierung gefüllt. Das hat den Grund, dass in der XML Datei diese Zellen zusammengehören und innerhalb eines Nodes befüllt werden. Damit bekannt ist, welche Eingabe innerhalb des einen Feldes zur Angabe des anderen Feldes gehört wurde hier die Befüllung mit Hilfe eines Indizes gewählt.

Zellenvalidierung

Feld	Name	Option	Regex Regex zur Option
1	Report Status		NEW
			CXL
2	Transaction Reference Number		"^[a-zA-Z0-9]{0,52}\$"
3	Trading venue transaction identification code		"^[a-zA-Z0-9]{0,52}\$"
4	Executing entity identification code		"^[A-Z0-9]{18}[0-9]{2}\\b\$"
5	Investment Firm covered by Directive 2014/65/EU		TRUE
			FALSE
6	Submitting entity identification code		"^[A-Z0-9]{18}[0-9]{2}\\b\$"
7	Buyer identification code		INTC
		LEI:	"^[A-Z0-9]{18}[0-9]{2}\\b\$"
		CCPT:	"^[A-Z]{2}[A-Z0-9+]{0,33}\\b\$"
		CONCAT:	"^[A-Z]{2}[0-9]{8}[A-Z]{1}[A-Z#]{4}[A-Z]{1}[A-Z#]{4}\$"
		NIDN:	"^[A-Z]{2}[A-Z0-9+]{0,33}\\b\$"
	MIC:	"^[A-Z0-9]{4}\$"	
8	Country of the branch for the buyer		"^[A-Z]{2}\$"
9	Buyer - first name(s)		"^[a-zA-Z0-9]{0,140}\$"
10	Buyer - surname(s)		"^[a-zA-Z0-9]{0,140}\$"
11	Buyer - date of birth		"^[0-9]{4}-[0-1][0-9]-[0-3][0-9]\$"
12	Buyer decision maker code		INTC

		LEI:	"^[A-Z0-9]{18}[0-9]{2}\\b\$"
		CCPT:	"^[A-Z]{2}[A-Z0-9+]{0,33}\\b\$"
		CONCAT:	"^[A-Z]{2}[0-9]{8}[A-Z]{1}[A-Z#]{4}[A-Z]{1}[A-Z#]{4}\$"
		NIDN:	"^[A-Z]{2}[A-Z0-9+]{0,33}\\b\$"
13	Buy decision maker - First Name(s)	"^[a-zA-Z0-9]{0,140}\$"	
14	Buy decision maker – Surname(s)	"^[a-zA-Z0-9]{0,140}\$"	
15	Buy decision maker - Date of birth	"^[0-9]{4}-[0-1][0-9]-[0-3][0-9]\$"	
16	Seller identification code	INTC	
		LEI:	"^[A-Z0-9]{18}[0-9]{2}\\b\$"
		CCPT:	"^[A-Z]{2}[A-Z0-9+]{0,33}\\b\$"
		CONCAT:	"^[A-Z]{2}[0-9]{8}[A-Z]{1}[A-Z#]{4}[A-Z]{1}[A-Z#]{4}\$"
		NIDN:	"^[A-Z]{2}[A-Z0-9+]{0,33}\\b\$"
	MIC:	"^[A-Z0-9]{4}\$"	
17	Country of the branch for the seller	"^[A-Z]{2}\$"	
18	Seller - first name(s)	"^[a-zA-Z0-9]{0,140}\$"	
19	Seller - surname(s)	"^[a-zA-Z0-9]{0,140}\$"	
20	Seller - date of birth	"^[0-9]{4}-[0-1][0-9]-[0-3][0-9]\$"	
21	Seller decision maker code	INTC	
		LEI:	"^[A-Z0-9]{18}[0-9]{2}\\b\$"
		CCPT:	"^[A-Z]{2}[A-Z0-9+]{0,33}\\b\$"
		CONCAT:	"^[A-Z]{2}[0-9]{8}[A-Z]{1}[A-Z#]{4}[A-Z]{1}[A-Z#]{4}\$"
	NIDN:	"^[A-Z]{2}[A-Z0-9+]{0,33}\\b\$"	
22	Seller decision maker - First Name(s)	"^[a-zA-Z0-9]{0,140}\$"	
23	Seller decision maker – Surname(s)	"^[a-zA-Z0-9]{0,140}\$"	
24	Seller decision maker - Date of birth	"^[0-9]{4}-[0-1][0-9]-[0-3][0-9]\$"	
25	Transmission of order indicator	TRUE	
		FALSE	
26	Transmitting firm identification code for the buyer	"^[A-Z0-9]{18}[0-9]{2}\\b\$"	
27	Transmitting firm identification code for the seller	"^[A-Z0-9]{18}[0-9]{2}\\b\$"	
28	Trading date time	"^[0-9]{4}-[0-1][0-9]-[0-3][0-9]T[0-2][0-9]:[0-6][0-9]:[0-6][0-9](\\.[0-9]{1,6})?Z\$"	
29	Trading capacity	DEAL	
		MTCH	



		AOTC	
30	Quantity	UNT:	("^[0-9]{1,18}\\.[0-9]{0,17}\$" && length <= 19) "^[0-9]{1,18}\$"
		NOM:	("^[0-9]{1,18}\\.[0-9]{0,5}\$" && length <= 19) "^[0-9]{1,18}\$"
		MON:	("^[0-9]{1,18}\\.[0-9]{0,5}\$" && length <= 19) "^[0-9]{1,18}\$"
31	Quantity currency	"^[A-Z]{3}\$"	
32	Derivative notional increase/decrease	INCR	
		DECR	
33	Price	PNDG	
		NOAP	
		PC:	("^[0-9]{1,11}\\.[0-9]{0,10}\$" && length <= 19) "^[0-9]{1,11}\$"
		MV:	("^[0-9]{1,18}\\.[0-9]{0,13}\$" && length <= 19) "^[0-9]{1,18}\$"
		YLD:	("^[0-9]{1,11}\\.[0-9]{0,10}\$" && length <= 12) "^[0-9]{1,11}\$"
	BP:	("^[0-9]{1,18}\\.[0-9]{0,17}\$" && length <= 19) "^[0-9]{1,18}\$"	
34	Price Currency	"^[A-Z]{3}\$"	
35	Net amount	Nettobetrag	
36	Venue	"^[A-Z0-9]{4}\$"	
37	Country of the branch membership	"^[A-Z]{2}\$"	
38	Up-front payment	("^[0-9]{1,18}\\.[0-9]{0,5}\$" && length <= 12) "^[0-9]{1,18}\$"	
39	Up-front payment currency	"^[A-Z]{3}\$"	
40	Complex trade component id	"^[a-zA-Z0-9]{0,35}\$"	
41	Instrument identification code	"^[A-Z]{2}[A-Z0-9]{9}[0-9]{1}\$"	
42	Instrument Full Name	length <= 350	
43	Instrument classification	"^[A-Z]{6}\$"	
44	Notional currency 1	"^[A-Z]{3}\$"	
45	Notional currency 2	FX:	"^[A-Z]{3}\$"
		INTRST:	"^[A-Z]{3}\$"
46	Price multiplier	("^[0-9]{1,18}\\.[0-9]{0,17}\$" && length <= 19) "^[0-9]{1,18}\$"	
47	Underlying instrument code	SWAP:0:	"[-+]\{\{([0-9]+:[A-Z]{2}[A-Z0-9]{9}[0-9]{1}[]*)\}\}([0-9]+:[A-Z]{2}[A-Z0-9]{9}[0-9]{1}[]*)\}\}\{[-+]\{\{([0-9]+:[A-Z]{2}[A-Z0-9]{9}[0-9]{1}[]*)\}\}([0-9]+:[A-Z]{2}[A-Z0-9]{9}[0-9]{1}[]*)\}\}\}?"
		OTHR:0:	"[-+]?\\{?([0-9]+:[A-Z]{2}[A-Z0-9]{9}[0-9]{1}[]*)\}\{([0-9]+:[A-Z]{2}[A-Z0-9]{9}[0-9]{1}[]*)\}\}\{?"
48	Underlying index name	[47] == SWAP:	"[-+]\{\{([0-9]+:[A-Z 0-9]{0,25}[]*)\}\}([0-9]+:[A-Z 0-9]{0,25}[]*)\}\}\{[-+]\{\{([0-9]+:[A-Z 0-9]{0,25}[]*)\}\}([0-9]+:[A-Z 0-9]{0,25}[]*)\}\}\}?"
		[47] == OTHR:	"[-+]?\\{?([0-9]+:[A-Z 0-9]{0,25}[]*)\}\{([0-9]+:[A-Z 0-9]{0,25}[]*)\}\}\{?"

49	Term of the underlying index ([47] == SWAP:)	DAYS#	"[+]\{\{([0-9]+:[A-Z]{4}#[0-9]{1,3})*([0-9]+:[A-Z]{4}#[0-9]{1,3}[]*)\}\};[+]\{\{([0-9]+:[A-Z]{4}#[0-9]{1,3})*([0-9]+:[A-Z]{4}#[0-9]{1,3}[]*)\}\}"
		WEEK#	
		MNTH#	
		YEAR#	
49	Term of the underlying index ([47] == OTHR:)	DAYS#	"[+]?\\{?([0-9]+:[A-Z]{4}#[0-9]{1,3})*([0-9]+:[A-Z]{4}#[0-9]{1,3}[]*)\\}?"
		WEEK#	
		MNTH#	
		YEAR#	
50	Option type	PUTO	
		CALL	
		OTHR	
51	Strike price	PNDG	
		NOAP	
		PC:	("^[0-9]{1,11}\\. [0-9]{0,10}\$" && length <= 19) "^[0-9]{1,11}\$"
		MV:	("^[0-9]{1,18}\\. [0-9]{0,13}\$" && length <= 19) "^[0-9]{1,18}\$"
		YLD:	("^[0-9]{1,11}\\. [0-9]{0,10}\$" && length <= 12) "^[0-9]{1,11}\$"
BP:	("^[0-9]{1,18}\\. [0-9]{0,17}\$" && length <= 19) "^[0-9]{1,18}\$"		
52	Strike price currency	"^[A-Z]{3}\$"	
53	Option exercise style	EURO	
		AMER	
		ASIA	
		BERM	
		OTHR	
54	Maturity date	"^[0-9]{4}-[0-1][0-9]-[0-3][0-9]\$"	
55	Expiry date	"^[0-9]{4}-[0-1][0-9]-[0-3][0-9]\$"	
56	Delivery type	PHYS	
		CASH	
		OPTL	
57	Investment decision within firm	CCPT:	"^[A-Z]{2}[A-Z0-9+]{0,33}\\b\$"
		CONCAT:	"^[A-Z]{2}[0-9]{8}[A-Z]{1}[A-Z#]{4}[A-Z]{1}[A-Z#]{4}\$"
		NIDN:	"^[A-Z]{2}[A-Z0-9+]{0,33}\\b\$"
58	Country of the branch responsible for the person making the investment decision	"^[A-Z]{2}\$"	
59	Execution within firm	CCPT:	"^[A-Z]{2}[A-Z0-9+]{0,33}\\b\$"
		CONCAT:	"^[A-Z]{2}[0-9]{8}[A-Z]{1}[A-Z#]{4}[A-Z]{1}[A-Z#]{4}\$"
		NIDN:	"^[A-Z]{2}[A-Z0-9+]{0,33}\\b\$"
		NORE	

60	Country of the branch supervising the person responsible for the execution	"^[A-Z]{2}\$"
61	Waiver indicator	RFPT
		NLIQ
		OILQ
		PRIC
		SIZE
		ILQD
62	Short selling indicator	SESH
		SSEX
		SELL
		UNDI
63	OTC post-trade indicator	BENC
		ACTX
		LRGS
		ILQD
		SIZE
		CANC
		AMND
		SDIV
		PRIC
		DUPL
		TNCP
		TPAC
		XFPH
64	Commodity derivative indicator	TRUE
		FALSE
65	Securities financing transaction indicator	TRUE
		FALSE

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.

MiFIR Meldetool Fehlerquellen

Pflichtfelder

Meldung einer Transaktion

- [1] Report status = NEW
- [2] Transaction Reference Number
- [4] Executing entity identification code

- [6] Submitting entity identification code
- [7] Buyer identification code
- [16] Seller identification code
- [25] Transmission of order indicator
- [28] Trading date time
- [29] Trading capacity
- [30] Quantity
- [33] Price
- [36] Venue
- [41] bzw [41-56] Instrument
- [59] Execution within firm
- [65] Securities financing transaction indicator

Stornierung einer Transaktion

- [1] Report status = CXL
- [2] Transaction Reference Number
- [4] Executing entity identification code
- [6] Submitting entity identification code

Sonderzeichen & Umlaute

Sonderzeichen & Umlaute werden nicht unterstützt. Falls doch Sonderzeichen und/oder Umlaute genutzt wurden erscheint folgender Fehler beim Melden an die BaFin: "An internal error has occurred".

Feld 2 "Transaction Reference Number"

In diesem Feld muss zu jeder Transaktion eine einzigartige Identifikationsnummer stehen. Diese Identifikation muss Meldungsübergreifend einzigartig sein, ansonsten wird die Transaktion verworfen.

Datum

Ein Datum wird immer wie folgt erwartet: YYYY-MM-DD. Beispiel: 2018-03-30

Folgende Felder sind betroffen:

Feld 11 "Buyer - date of birth"

Feld 15 "Buy decision maker - Date of birth"

Feld 20 "Seller - date of birth"

Feld 24 "Sell decision maker - Date of birth"

Feld 54 "Maturity date"

Feld 55 "Expiry date"

Feld 28 "Trading date time"

Der Handelszeitpunkt hat folgendes Format: YYYY-MM-DDThh:mm:ss.sssssZ, mit einer Genauigkeit von mindestens Sekunden.

Beispiel: 2018-03-25T12:30:25Z oder 2018-03-25T12:30:25.123456Z

Dabei ist zu beachten, dass die Angabe in [UTC-0](#) erwartet wird.

Feld 29 "Trading capacity"

Hier wird für den zuvor geschilderten Grundsachverhalt der Vermittler und Portfolioverwalter gelegentlich „MTCH“ angegeben.

Das würde aber bedeuten, dass ich eine Order eines Käufers und eines Verkäufers vorliegen hätte, die zufällig miteinander matchen, sodass ich die Orders nicht zur externen Ausführung weiterleiten muss.

Im Normalfall leiten Sie aber Kundenorders an ausführende Einheiten weiter, so dass dann „AOTC“ als Handelskapazität zu setzen wäre, wird das eigene Buch dazwischen geschaltet entsprechend „DEAL“.

Feld 52 "Strike price currency"

Der Preis ist, falls Nachkommastellen vorhanden sind, mit . statt , anzugeben. Beispiel: 123.55

LEI

Eine LEI ist immer 20-stellig mit 2 Ziffern am Ende. Der Dienst [Gleif](#) kann bei der Überprüfung helfen.

Concat

[Anleitung \(Seite 27ff 5.5.1 Verfahren zur Erstellung der CONCAT-Kennung\):](#)

Mit folgender Formel wird das CONCAT gebildet

2 Buchstaben (Ländercode) +

8 Zahlen (Geburtsdatum YYYYMMDD)

1 Buchstabe + 4 Buchstaben oder # (Vorname) +

1 Buchstabe + 4 Buchstaben oder # (Nachname)

Ein Beispiel:

Land: Deutschland, Geburtsdatum: 30-06-1950, Name: Max, Nachname: Mustermann

CONCAT: DE19500630MAX##MUSTE

Hinweise der BaFin

Hier handelt es sich um einen Ausschnitt der Informationen, welche die BaFin am 05.03.2018 an die registrierten "Direktmelder" versendet hat. Die Veröffentlichung an dieser Stelle erfolgt mit Genehmigung der BaFin.

Feld 4 "Executing entity identification Code"

Hier ist die Wertpapierfirma einzutragen, die die Meldepflicht nach Art. 26 (1) MiFIR zu erfüllen hat oder die nicht meldepflichtige Firma, für die der Handelsplatz melden muss, Art. 26 (7) MiFIR.

Es ist also nicht ein Kommissionär einzutragen, an den eine Order zur Ausführung geroutet wird.

Feld 5 "Investment Firm covered by Directive 2014/65/EU"

Der Indikator beschreibt, ob der Meldepflichtige in Feld 4 eine Wertpapierfirma ist und damit selbst nach Art. 26 (1) MiFIR melden muss, oder ob in Feld 4 ein selbst nicht Meldepflichtiger eingetragen wurde, für den der Handelsplatz melden muss, Art. 26 (7) MiFIR.

Von Direktmeldern, die über die MVP Ihre eigene Meldepflicht nach Art. 26 (1) MiFIR erfüllen, ist also immer der Defaultwert „true“ zu verwenden.

Felder 7 bis 24 "Beteiligte"

Bei der Angabe von natürlichen Personen als Käufer/Verkäufer sind die Felder Nachname, Vorname und Geburtsdatum Pflichtfelder.

Auch wenn z.B. im CONCAT das Geburtsdatum enthalten ist, so ist es als Einzelfeld ebenfalls anzugeben. Häufig kommt es zu Validierungsfehlern „Falscher CONCAT“.

In der Regel ist in diesen Fällen der CONCAT selbst sogar richtig angegeben, aber eines der Bezugfelder ist fehlerhaft oder fehlend.

Achten Sie in diesem Zusammenhang bitte auch auf die Formatvorgaben. Das Geburtsdatum hat das „Date“-Format. Anders als im Zeitstempel, in dem z.B. mittels Buchstabe „Z“ die UTC Zeitzone angegeben wird, ist das im Datumsfeld nicht möglich.

Nicht alle natürlichen Personen werden mittels der nationalen Identifikationsart „CONCAT“ gemeldet, siehe Art. 6 DVO (EU) 2017/590 (RTS 22). Im Meldesatz selbst sind drei Unterfälle zu unterscheiden.

Der CONCAT wird im Tag Prtry mit „CONCAT“ angegeben, eine Steuernummer müsste über den Eintrag „NIDN“ erklärt werden, eine nationale Kennung über „CCPT“.

Die generelle Verwendung von CONCAT ist also nicht möglich, siehe Punkt 5.8.2.1 der Guidelines, letzter Absatz. ([esma Guidelines](#))

Country of branch

Betroffene Felder:

Feld 8 "Country of the branch for the buyer"

Feld 17 "Country of the branch for the seller"

Feld 37 "Country of the branch membership"

Feld 58 "Country of the branch responsible for the person making the investment decision"

Feld 60 "Country of the branch supervising the person responsible for the execution"

Immer wenn eine „Country of the branch ...“ zu befüllen ist, liegt der Bezug auf Feld 4, also auf der Sicht des Meldepflichtigen.

Sehr häufig wird in Feld 8 und 17 derzeit abgebildet, wo der Käufer/Verkäufer seinen Sitz/Wohnsitz hat.

Wenn der Käufer z.B. eine Großbank ist, die diverse Zweigstellen weltweit hat und man eine Börsenorder an die Zweigstelle dieser Firma im Ausland adressiert, so liegt der Bezug gerade nicht auf dem Käufer/Verkäufer, sondern darauf, ob der Meldepflichtige selbst eine eigene Zweigstelle einbindet, um mit dem Käufer/Verkäufer zu handeln. Bin ich eine deutsche Wertpapierfirma ohne Zweigstellen, ist in Feld 8 und 17 der Ländercode meines Heimatstaates zu verwenden, also „DE“.

Dieser Bezugsfehler, statt fälschlicherweise auf Käufer/Verkäufer und nicht auf sich selbst abzustellen, kommt in nahezu jeder abgegebenen Meldung von Direktmeldern vor.

Feld 25 "Transmission of order indicator"

Eine der häufigsten Fehlerquellen ist der Transmission-Indikator in Feld 25.

Inhaltlich bildet dieser Indikator gerade nicht ab, ob eine erfolgreiche Transmission vorlag, denn wäre dies der Fall, hätte die Wertpapierfirma nach Art 3 (2) RTS 22 schon kein meldepflichtiges Geschäft ausgeführt.

Der Indikator zeigt lediglich an, dass eine Transmission/Übermittlung einer Order an eine ausführende Partei vorlag, bei der die Möglichkeit aus Art. 4 RTS 22 nicht in Anspruch genommen wurde.

Bin ich der Überbringer einer Order, ist der Wert „true“ zu verwenden.

Der Grundsachverhalt vieler Anlagevermittler und Portfolioverwalter ist der, dass für einen Mandanten eine Order an ein ausführendes Institut adressiert wird (in der Regel die Depotbank). Steht die ausführende Depotbank als Empfängerfirma bereit, kann die eigene Meldepflicht des Übermittlers unter den Voraussetzungen von Art. 4 RTS 22 entfallen. Steht die Empfängerfirma für

eine Transmission im Sinne von Art. 4 RTS nicht zur Verfügung, oder scheidet es schon am Status der Empfängerfirma als Wertpapierfirma (alle Drittlandfirmen, über die gehandelt wird, die nicht unter die MIFIR fallen) ist eine Meldung abzugeben, in der Feld 25 mit „true“ zu befüllen ist, weil eine Transmission vorliegt, die aber nicht erfolgreich im Sinne von Art. 4 RTS 22 war.

Feld 29 "Trading capacity"

Hier wird für den zuvor geschilderten Grundsachverhalt der Vermittler und Portfolioverwalter gelegentlich „MTCH“ angegeben.

Das würde aber bedeuten, dass ich eine Order eines Käufers und eines Verkäufers vorliegen hätte, die zufällig miteinander matchen, sodass ich die Orders nicht zur externen Ausführung weiterleiten muss.

Im Normalfall leiten Sie aber Kundenorders an ausführende Einheiten weiter, so dass dann „AOTC“ als Handelskapazität zu setzen wäre, wird das eigene Buch dazwischen geschaltet entsprechend „DEAL“.

Feld 33 "Price"

Das Preisfeld kann verschiedene Ausprägungen haben, die in der Feldbeschreibung aufgeführt sind.

Bei einem Aktiengeschäft wäre der Ausführungspreis pro Stück zu melden. Sehr häufig wird in den bisher abgegebenen Meldedaten hier aber das Volumen aus Menge mal Preis pro Stück gemeldet. Werden z.B. 100 Thyssen Aktien gekauft, so wird uns hier sehr oft ein Preis von ca. 2400 EUR gemeldet. Dieser Fehler ist gravierend, weil alle Analysen, die auf auffällige Preisangaben beruhen, auf falschen Quelldaten rechnen.

Bitte überprüfen Sie daher dringend, ob Sie die Preisangabe vergleichbar der zahlreichen Fallbeispiele in den Guidelines abbilden. ([esma Guidelines](#))

Feld 36 "Venue"

Wie schon zu Feld 3 beschrieben, meldet nur die Markttinnenseite das Handelssegment mit einer MIC-Angabe. Außenseiten melden immer XOFF oder XXXX.

Wird z.B. von einem Portfolioverwalter eine Kundenorder an die Depotbank geroutet, die das Geschäft an einem Börsenplatz ausführt, so meldet nur diese ausführende Bank den Börsen-MIC, in der eigenen Meldung muss XOFF in Feld 36 eingetragen werden. Sehen Sie hierzu bitte die Erklärung unter Punkt 5.4.2. der Guidelines. ([esma Guidelines](#))

Feld 37 "Country of the branch Membership"

Dieses Feld ist ein Pflichtfeld, wenn in Feld 36 ein Handelsplatz mittels MIC identifiziert wurde. Wird Feld 36 mit XOFF oder XXXX gemeldet, ist es leer zu lassen.

Hinweis zu MVP Feedback-files:

Für alle Melder, deren Datei zwar angenommen wird, dann aber die Prüfung auf File-Ebene zur Ablehnung von einzelnen Meldesätzen führt, gilt, dass Sie die im Feedback zurück gelieferten Fehlertickets „CON –XXX“ mit der von ESMA zur Verfügung gestellten Quelle vergleichen sollten. ([ESMA](#))

Rule ID	Field	FIELD	CONTENT TO BE REPORTED	FORMAT AND STANDARDS TO BE USED FOR REPORTING	Validation rule	Implementation	Error code	Error text	Set
240	7	Buyer identification code			If the CONCAT code is used, the birthdate in the CONCAT code should be the same as the birthdate populated in field 11.	Application	CON-073	The CONCAT code XXX is incorrect	1

Über die Spalte Error-Code, die Ihnen im Feedback zurück geliefert wird, erhalten Sie einen Bezug zu dem Feld, zu dem die Regel erstellt wurde (hier vorliegend CON-073, der auf der Regel zu Feld 7 basiert). Der Error Text, der Ihnen im MVP Journal angezeigt wird, beschreibt nur den Kontext, in dem das Problem aufgetreten ist (hier falsche CONCAT-Bildung).

Den eigentlichen Grund für die Ablehnung erhalten Sie erst durch die Rule-Beschreibung selbst (hier Geburtstag aus CONCAT und Feld Geburtsdatum stimmt nicht überein).

Bitte nutzen Sie diese Quelle unbedingt, wenn Sie die Ursache der Ablehnung Ihrer Meldung finden müssen.

Änderungshistorie

180601

- Meldung an FMA Liechtenstein und Abholen der FMA Liechtenstein Rückmeldung
- Abholen der BaFin Rückmeldung
- Bugfix: Wenn der CFI – Code [43] mit D beginnt und Quantity [30] in Units angegeben werden darf der Preis [33] nicht in Prozent angegeben sein. Vorher wurde nur nach CFI-Code und Preis validiert, Quantity wurde nicht beachtet.
- Bugfix: Fälschlicherweise wurde bei manchen Transaktionen ein leeres Object von Expiry Date erstellt, wodurch diese Transaktionen bei der BaFin nicht gemeldet werden konnten. Dieser Fehler wurde behoben.
- BugFix: "Index Out Of Bounce Exception" kommt nicht mehr auf bei der Konvertierung von CSV - Dateien.
- Falsche Referenzierung in einer Fehlermeldung wurde korrigiert.

180509

- Erweiterung um .csv als gültiges Importformat
- Vier neue Parameter wurden zur Konverter Konfigurationsdateie hinzugefügt:
 - „toCc“: dient als Referenz an welche Aufsichtsbehörde gemeldet wird (zB: „LI“, „DE“)
 - „allowRowValidation“: aktiviert Reihen-Validierung
 - „allowCellValidation“: aktiviert Zellen-Validierung
 - „seqNum“: führt eine fortlaufende Sequenz Nummer um alle XML Zieldateien zu nummerieren. Dies wird von Liechtenstein vorausgesetzt und von der BaFin toleriert.
- Durch die Neuen Konfigurationsparameter wird dem Nutzer ermöglicht die Validierung zu aktivieren und deaktivieren.
- Die neue Version des Konverters ermöglicht nun das Melden an die Aufsichtsbehörde in Liechtenstein.
- 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.
- Bugfix: Namen und Vornamen können jetzt auch Leerzeichen beinhalten.

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

171220

- 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.