

BaFin | Postfach 50 01 54 | 60391 Frankfurt

An alle Meldepflichtige

18.12.2003
GZ: IT 4 - W 2110 - 65/2003 (Bitte stets angeben)
03061249

**Meldewesen gemäß § 9 Wertpapierhandelsgesetz (WpHG)
Rundschreiben 11/2003 (WA)**

Sehr geehrte Damen und Herren,

im Zusammenhang mit auftretenden Problemen bezüglich des
Meldewesens nach § 9 WpHG bitte ich, die folgenden Klarstellungen zu
beachten. Behandelt werden im Einzelnen die folgenden Themen:

- Nutzung von Börsenschlüsseln der WM Tabelle G32
- Darstellung von IW-, Groß- und Sammelorders
- Hinweis zur Meldepflicht von Kapitalanlagegesellschaften
- Hinweis auf die Homepage der BaFin

Bei Rückfragen wenden Sie sich bitte an das Sachgebiet Meldewesen § 9
WpHG im Referat IT 4 (Informationstechnik Frankfurt und Meldewesen
nach § 9 WpHG). Adresse: Lurgiallee 12, 60439 Frankfurt am Main; Fax:
0228 – 4108 5250.

Nutzung der Börsenschlüssel der WM Tabelle G32

Aus gegebenem Anlass weise ich darauf hin, dass der in § 7 der
Wertpapierhandel-Meldeverordnung (WpHMV) gewählte Begriff des
„Handelssegments“ hinsichtlich der Verwendung von Schlüsseln aus dem
Börsentabellenband WM G32 so zu interpretieren ist, dass immer nur die
Hauptschlüssel eigenständiger Handelsplätze zu verwenden sind. Die
vom WM Daten Service vergebenen Schlüssel zur Unterscheidung z.B.
von amtlichem bzw. geregelter Markt oder Freiverkehr dürfen nicht
verwendet werden. Eine Ausnahme hiervon stellen Handelsplattformen
dar, die einen eigenen Kreis von Handelsteilnehmern haben (z. B.
Quotrix).

Gruppe Informationstechnik

Hausanschrift:
Bundesanstalt für
Finanzdienstleistungsaufsicht
Lurgiallee 12
60439 Frankfurt | Germany

Kontakt:
Michael Kollak
Referat IT 4
Fon +49 (0)2 28 41 08-3248
Fax +49 (0)2 28 41 08-5250
Michael.Kollak@bafin.de
www.bafin.de

Zentrale:
Fon +49 (0)2 28 41 08-0
Fax +49 (0)2 28 41 08-123

Dienstsitze:
53117 Bonn
Graurheindorfer Str. 108
Georg-von-Boeselager-Str. 25
Friedrich-Wöhler-Str. 2

60439 Frankfurt
Lurgiallee 12

Darstellung von IW-, Groß- und Sammelorders

Nach Abstimmung mit den Verbänden der Kreditwirtschaft zum Thema „Meldung von IW-Geschäften“ publiziert die BaFin im Folgenden die für das Meldewesen nach § 9 WpHG verbindlichen Regelungen, welche bis zum 01.04.2004 umzusetzen sind.

Unter den meldetechnischen Terminus der „IW-Order“ fallen neben den interessewahrenden Orders auch die im Markt genutzten Begriffe „Großorder“ und „Sammelorder“. Bei der korrekten Kennzeichnung und Meldung von IW-Geschäften spielen Risikobetrachtungen im Hinblick auf die Eigenkapitalausstattung bei den Meldepflichtigen sowie etwaige Abwicklungsaspekte bei den getätigten Wertpapiergeschäften selbst keine Rolle.

Es obliegt den Meldepflichtigen, die Einstufung als IW-Order vorzunehmen. Ausschlaggebend sind in diesem Kontext die mit dem Kunden getroffenen Vereinbarungen. Die Kennzeichnung als Eigengeschäft, wie sie im Meldesatz bei der Benutzung der 2. Möglichkeit vorzunehmen ist, impliziert nicht die Verwendung des P Accounts beim Handel. Für die korrekte Verwendung der Accounts sind anderweitige Regelungen z.B. der Handelsüberwachungsstellen zu berücksichtigen. Es handelt sich hier um eine Darstellungstechnik im Rahmen des Meldewesens nach § 9 WpHG.

Der Meldepflichtige hat zwei Wahlmöglichkeiten für die Meldung von IW-Geschäften.

1. Möglichkeit:

Der Meldepflichtige klassifiziert alle (Teil-)Geschäfte als Kundengeschäfte, bei denen der Eigenbestand nicht betroffen ist (Feld Nr. 19 = „N“, Feld Nr. 20 = „K“). Es sind der tatsächliche Handelstag und die -zeit sowie das Handelssegment der Ausführung zu melden. Meldepflichtige Kunden müssen zu jeder Teilausführung eine in allen Einzelheiten deckungsgleiche Gegenmeldung erstellen. Von den Meldesätzen abweichende Abwicklungsvereinbarungen (Stichwort: Schnittkursabrechnung) sind hier für die zu erstellenden Meldesätze irrelevant.

2. Möglichkeit:

Der Meldepflichtige meldet alle (Teil-)Geschäfte als Eigengeschäfte, bei denen der Eigenbestand betroffen ist (Feld Nr. 19 = „J“, Feld Nr. 20 = „E“). Anschließend ist ein weiterer Meldesatz zu generieren. In diesem

Seite 3 | 3

ist der Eintrag für die Meldefelder Nr. 21 (Börsenpreis) und Nr. 23 (Handelssegment) defaultmäßig „N/0“. Der Geschäftstyp ist mit „4“ für IW-Geschäft zu kennzeichnen. Der Kurs (Feld Nr. 27) enthält den mit dem Kunden vereinbarten Preis. Als Handelstag bzw. –zeit wird der Belieferungstag bzw. –zeitpunkt gemeldet. Meldepflichtige Kunden müssen ihrerseits eine Gegenmeldung über ein außerbörsliches Direktgeschäft erstellen (Geschäftstyp ist dabei ungleich „4“).

Sofern sich meldepflichtige Unternehmen i.S.d. § 9 Abs. 1 Satz 4 WpHG (Börsenteilnehmer mit Sitz im Ausland) für die o.g. 2. Möglichkeit entscheiden, müssen auch diese der BaFin das außerbörsliche Geschäft mit Geschäftstyp „4“ melden. Diese Meldung ist erforderlich, um die Vollständigkeit der Meldedaten zu überwachen sowie insiderrelevante Untersuchungen zu ermöglichen.

Hinweis zur Meldepflicht von Kapitalanlagegesellschaften

Die BaFin hat nach erneuter eingehender Prüfung ihre in dem Rundschreiben vom 15.11.2002 geäußerte Ansicht zur Meldepflicht von Kapitalanlagegesellschaften revidiert. Danach besteht für Kapitalanlagegesellschaften keine Meldepflicht nach § 9 WpHG für Geschäfte, die diese für ihre Sondervermögen abschließen (Investmentgeschäfte). Davon unberührt bleibt die Meldepflicht für Eigengeschäfte und Geschäfte im Zusammenhang mit einer Wertpapierdienstleistung.

Die Abgabe von Transaktionsmeldungen im Zusammenhang mit Investmentgeschäften wird künftig im Investmentgesetz geregelt. Hier ergeben sich Veränderungen durch das kommende Investmentmodernisierungsgesetz.

Hinweis auf die Homepage der BaFin

Ich möchte Sie darauf hinweisen, dass Sie die Möglichkeit haben, alle Rundschreiben, die das Meldewesen nach § 9 WpHG betreffen, zeitnah auf der Homepage der BaFin (<http://www.bafin.de>) unter dem Punkt „[BaFin-Startseite](#) »» [Für Anbieter](#) »» [Wertpapierdienstleistungsunternehmen](#) »» [Informationen zu den Meldepflichten nach § 9 WpHG](#)“ abzurufen.

Mit freundlichen Grüßen
Im Auftrag

Glaszner