

BUNDESGESETZBLATT

FÜR DIE REPUBLIK ÖSTERREICH

Jahrgang 2005

Ausgegeben am 1. August 2005

Teil II

239. Verordnung: Derivate-Meldesystemverordnung

239. Verordnung der Finanzmarktaufsichtsbehörde (FMA) über die Art der elektronischen Übermittlung der Meldung von Derivaten (Derivate-Meldesystemverordnung)

Auf Grund des § 21 Abs. 2 des Investmentfondsgesetzes – InvFG 1993, BGBl. Nr. 532 Art. II, zuletzt geändert durch das Bundesgesetz BGBl. I Nr. 78/2005, wird verordnet:

Übertragungsweg

§ 1. Die Kapitalanlagegesellschaften haben die Meldesätze gemäß der 2. Derivate-Risikoberechnungs- und Meldeverordnung, BGBl. II Nr. 238/2005, an die E-Mail Adresse „derivate@fma.gv.at“ zu übermitteln.

Verfahrensablauf

§ 2. Bei der Übernahme der Meldesätze durch die FMA erfolgt keine Empfangsbestätigung. Bei falschen Meldungen wird die Meldedatei an die Kapitalanlagegesellschaft zurückgesandt. Zu diesem Zweck ist der FMA spätestens bis zum 30. September 2005 eine E-Mail Adresse bekannt zu geben. Änderungen dieser Adresse sind unverzüglich mitzuteilen.

Meldeformat

§ 3. (1) Die Meldesätze sind im Comma Separated Values (CSV) – Format mit einem Strichpunkt als Listentrennzeichen an die in § 1 genannte E-Mail Adresse zu übermitteln. Die gesamte Meldung einer Kapitalanlagegesellschaft hat in einem File zu erfolgen. In der ersten Zeile des Meldefiles ist der Name und die Bankleitzahl der Kapitalanlagegesellschaft, getrennt durch einen Strichpunkt wie folgt zu melden:

1. Name der Kapitalanlagegesellschaft, max. 150 Stellen, alphanumerisch;
2. Bankleitzahl der Kapitalanlagegesellschaft, max. 5 Stellen, numerisch;

(2) Für jeden Fonds ist eine eigene Meldezeile zu verwenden. In dieser Meldezeile sind folgende Daten in der vorgegebenen Reihenfolge anzugeben:

1. Angaben Securities Identification Number (ISIN) des Fonds, max. 12 Zeichen, alphanumerisch;
2. Name des Fonds, max. 100 Zeichen, alphanumerisch;
3. Risikoangabe in Prozent, max. 3 Stellen, numerisch;
4. Zusätzliche Anwendung des VaR-Approach, eine Stelle, „J“/“j“ bzw. „N“/“n“;
5. Anwendung des relativen VaR-Approach, eine Stelle, „J“/“j“ bzw. „N“/“n“;
6. Anwendung des absoluten VaR-Approach, eine Stelle, „J“/“j“ bzw. „N“/“n“;
7. Besonderen Anlagegrenzen laut Fondsbestimmungen, max. 300 Stellen, alphanumerisch;
8. Arten der Derivate, eine Stelle, „J“/“j“ bzw. „N“/“n“, in der in Anlage 1 und Anlage 2 dargelegten Reihenfolge;

Trennzeichen zwischen den Feldern ist ein Strichpunkt. Am Ende jedes Fonds folgt ein Carriage Return/Line Feed (CRLF). Den Kapitalanlagegesellschaften steht eine Pretty Good Privacy (PGP) Verschlüsselung frei.

(3) Im Falle von Leermeldungen werden nur ISIN, Name des Fonds und Risikoangabe übermittelt. Bei Teilmeldungen können alle in **Anlage 1** und **Anlage 2** als „N/n“ bezeichneten Positionen ausgelassen werden.

In-Kraft-Treten

§ 4. Diese Verordnung tritt mit 10. August 2005 in Kraft und ist erstmals auf Meldungen zum 30. September 2005 anzuwenden.

Pribil Traumüller

