

BUNDESGESETZBLATT

FÜR DIE REPUBLIK ÖSTERREICH

Jahrgang 2011

Ausgegeben am 17. August 2011

Teil II

267. Verordnung: Derivate-Meldesystemverordnung 2011 – DMV 2011

267. Verordnung der Finanzmarktaufsichtsbehörde (FMA) über die Art der elektronischen Übermittlung der Meldung von Derivaten (Derivate-Meldesystemverordnung 2011 – DMV 2011)

Auf Grund des § 152 des Investmentfondsgesetzes – InvFG 2011, BGBl. I Nr. 77, wird verordnet:

Übermittlung

§ 1. (1) Die Verwaltungsgesellschaften haben die Meldesätze gemäß der 4. Derivate-Risikoberechnungs- und Meldeverordnung, BGBl. II Nr. 266/2011, an die E-Mail Adresse „derivate@fma.gv.at“ zu übermitteln.

(2) Bei der Übernahme der Meldesätze durch die FMA erfolgt keine Empfangsbestätigung. Bei falschen Meldungen wird die Meldedatei an die Verwaltungsgesellschaft zurückgesandt. Zu diesem Zweck ist der FMA von der Verwaltungsgesellschaft eine E-Mail Adresse bekannt zu geben, soweit eine solche nicht bereits mitgeteilt wurde. Änderungen dieser Adresse sind unverzüglich mitzuteilen.

Meldeformat

§ 2. (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 Verwaltungsgesellschaft hat in einer Datei (File) zu erfolgen. In der ersten Zeile der Meldedatei sind der Name und die Bankleitzahl der Verwaltungsgesellschaft, getrennt durch einen Strichpunkt, wie folgt zu melden:

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

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

1. International Securities Identification Number (ISIN) des Investmentfonds, max. 12 Zeichen, alphanumerisch;
2. Name des Investmentfonds, max. 100 Zeichen, alphanumerisch;
3. Risikoangabe in Prozent, max. 3 Stellen, numerisch;
4. Maximale Risikoangabe der Berichtsperiode in Prozent, max. 3 Stellen, numerisch;
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;

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

(3) Im Falle von Leermeldungen werden nur ISIN, Name des Investmentfonds und Risikoangabe übermittelt.

Inkrafttreten und Außerkrafttreten

§ 3. (1) Diese Verordnung tritt am 1. September 2011 in Kraft und ist erstmals auf Meldungen zum 30. September 2011 anzuwenden.

(2) Die Verordnung der Finanzmarktaufsichtsbehörde (FMA) über die Art der elektronischen Übermittlung der Meldung von Derivaten (Derivate-Meldesystemverordnung), BGBI. II Nr. 239/2005, in der Fassung der Verordnung BGBI. II Nr. 170/2008, tritt mit Ablauf des 31. August 2011 außer Kraft.

Ettl Pribil

