

Frankfurt, 02.04.2015
Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht
Abteilung WA 4 – Aufsicht über Kapitalanlagegesellschaften
Marie-Curie-Straße 24 - 28
60439 Frankfurt am Main

Handreichung zum AIFMD- Reporting; hier: Kommentiertes Beispiel einer AIFM-Meldung im XML-Format

I. Inhalt

- I. Inhalt
- II. Allgemeine Anmerkungen
- III. Auszug aus Anhang IV der delegierten Verordnung mit Referenzen für die Kommentierungstabelle
- IV. Unkommentiertes Beispiel einer erfolgreichen AIFM-Meldung
- V. Kommentierte Version der AIFM-Meldung
- VI. Kontakt & technischer Support

II. Allgemeine Anmerkungen

Bitte beachten Sie zunächst die erforderliche gz-Komprimierung und die Dateinamenskennung entsprechend unserem Merkblatt.

Auch Korrekturen zu bereits übertragenen AIFM-Dateien müssen immer vollständig eingereicht werden. Die drei XML-Elemente AIFMNationalCode, ReportingPeriodType u. ReportingPeriodYear bilden zusammen einen fachlich eindeutigen Schlüssel. Ein übertragenes Dokument mit gleichem fachlichem Schlüssel überschreibt ein bereits gespeichertes Dokument vollständig. Alle eingereichten Meldungen werden jedoch durch die BaFin archiviert. Datensätze der Art Cancellation sind nur zur dauerhaften Löschung notwendig.

Für jede eingereichte Meldung wird immer eine weitere XML-Datei durch die BaFin als Antwort (Feedback-Datei) erzeugt, welche zum Download im Portal bereitgestellt wird. Dies geschieht nicht zeitnah und kann insbesondere nach Anbindung des Systems an das System von ESMA bis zu einigen Tagen dauern. In dieser Feedback-Datei sind möglicherweise Fehler aufgelistet. Ein Fehler zeichnet sich durch einen Fehlercode (XML-Element AIFMErrorReference) und eine Beschreibung in Englisch (XML-Element AIFMErrorMessage) aus. Ist die eingereichte Datei fehlerfrei, dann ist dies in der Datei durch <NoErrors>OK</NoErrors> vermerkt. Fehlerhafte Dateien müssen korrigiert und vollständig neu eingereicht werden.

III. Auszug aus Anhang IV der delegierten Verordnung mit Referenzen für die Kommentierungstabelle

ANHANG IV

Formblatt für die Berichterstattung: AIFM

(Artikel 3 Absatz 3 Buchstabe d und Artikel 24 der Richtlinie 2011/61/EU)

Angaben zum AIFM

(Artikel 3 Absatz 3 Buchstabe d und Artikel 24 Absatz 1 der Richtlinie 2011/61/EU)

		Wichtigster Markt/wichtigstes Instrument	Zweitwichtigster Markt/zweitwichtigstes Instrument	Drittwichtigster Markt/drittwichtigstes Instrument	Viertwichtigster Markt/viertwichtigstes Instrument	Fünfwichtigster Markt/fünfwichtigstes Instrument
1	Wichtigste Märkte des Handels für Rechnung der vom AIFM verwalteten AIF	A1	A2	A3	A4	A5
2	Wichtigste Instrumente des Handels für Rechnung der vom AIFM verwalteten AIF	B1	B2	B3	B4	B5
3	Verwaltete Vermögenswerte aller verwalteten AIF, berechnet gemäß Artikel 2	In der Basiswährung (wenn für alle AIF gleich) C		In EUR D		
	Bitte Angabe von offizieller Bezeichnung, Ort und Rechtsordnung der Märkte					

IV. Unkommentiertes Beispiel einer erfolgreichen AIFM-Meldung:

(Doppelte Absätze dienen der übersichtlicheren Darstellung der Gliederung und sind nicht in die XML-Datei zu übernehmen. Datenbestand wurde anonymisiert. Benötigen Sie eine Vorlage für die Erstellung einer eigenen XML-Datei, so verwenden Sie zweckmäßigerweise bitte unsere unkommentierte XML-Beispielsdatei. Diese können Sie am einfachsten mit dem Texteditor öffnen und die enthaltenen Daten mit den Werten Ihres Hauses überschreiben. Die Verwendung von Word empfehlen wir hierfür nicht.)

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8" ?>
<AIFMReportingInfo xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xsi:noNamespaceSchemaLocation="AIFMD_DATMAN_V1.2.xsd" ReportingMemberState="DE" Version="1.2"
CreationDateAndTime="2015-03-02T12:42:41">
```

```
- <AIFMRecordInfo>
  <FilingType>INIT</FilingType>
  <AIFMContentType>1</AIFMContentType>
  <ReportingPeriodStartDate>2014-10-01</ReportingPeriodStartDate>
  <ReportingPeriodEndDate>2014-12-31</ReportingPeriodEndDate>
  <ReportingPeriodType>Q4</ReportingPeriodType>
  <ReportingPeriodYear>2014</ReportingPeriodYear>
  <LastReportingFlag>>false</LastReportingFlag>

- <Assumptions>
  - <Assumption>
    <QuestionNumber>1</QuestionNumber>
    <AssumptionDescription>TEST</AssumptionDescription>
  </Assumption>
</Assumptions>

  <AIFMReportingCode>5</AIFMReportingCode>
  <AIFMJurisdiction>DE</AIFMJurisdiction>
  <AIFMNationalCode>10XXXXXX</AIFMNationalCode>
  <AIFMName>NAME</AIFMName>
  <AIFMEEAFlag>>true</AIFMEEAFlag>
  <AIFMNoReportingFlag>>false</AIFMNoReportingFlag>

- <AIFMCompleteDescription>

  - <AIFMIdentifier>
    <AIFMIdentifierLEI>LEI1234567890123456789</AIFMIdentifierLEI>
    <AIFMIdentifierBIC>TESTDE20XXX</AIFMIdentifierBIC>
  </AIFMIdentifier>

  - <AIFMPrincipalMarkets>
    - <AIFMFivePrincipalMarket>
      <Ranking>1</Ranking>
      - <MarketIdentification>
        <MarketCodeType>XXX</MarketCodeType>
      </MarketIdentification>
      <AggregatedValueAmount>3657723241</AggregatedValueAmount>
    </AIFMFivePrincipalMarket>
```

```
- <AIFMFivePrincipalMarket>
  <Ranking>2</Ranking>
- <MarketIdentification>
  <MarketCodeType>XXX</MarketCodeType>
</MarketIdentification>
  <AggregatedValueAmount>108007823</AggregatedValueAmount>
</AIFMFivePrincipalMarket>
- <AIFMFivePrincipalMarket>
  <Ranking>3</Ranking>
- <MarketIdentification>
  <MarketCodeType>XXX</MarketCodeType>
</MarketIdentification>
  <AggregatedValueAmount>201265377</AggregatedValueAmount>
</AIFMFivePrincipalMarket>
- <AIFMFivePrincipalMarket>
  <Ranking>4</Ranking>
- <MarketIdentification>
  <MarketCodeType>OTC</MarketCodeType>
</MarketIdentification>
  <AggregatedValueAmount>2345768</AggregatedValueAmount>
</AIFMFivePrincipalMarket>
- <AIFMFivePrincipalMarket>
  <Ranking>5</Ranking>
- <MarketIdentification>
  <MarketCodeType>MIC</MarketCodeType>
  <MarketCode>XMUN</MarketCode>
</MarketIdentification>
  <AggregatedValueAmount>1647581</AggregatedValueAmount>
</AIFMFivePrincipalMarket>
</AIFMPrincipalMarkets>

- <AIFMPrincipalInstruments>
- <AIFMPrincipalInstrument>
  <Ranking>1</Ranking>
  <SubAssetType>PHY_RES_COML</SubAssetType>
  <AggregatedValueAmount>3210283231</AggregatedValueAmount>
</AIFMPrincipalInstrument>
- <AIFMPrincipalInstrument>
  <Ranking>2</Ranking>
  <SubAssetType>PHY_RES_RESL</SubAssetType>
  <AggregatedValueAmount>1256344376</AggregatedValueAmount>
</AIFMPrincipalInstrument>
- <AIFMPrincipalInstrument>
  <Ranking>3</Ranking>
  <SubAssetType>SEC_SSP_RMBS</SubAssetType>
  <AggregatedValueAmount>20028113</AggregatedValueAmount>
</AIFMPrincipalInstrument>
- <AIFMPrincipalInstrument>
  <Ranking>4</Ranking>
  <SubAssetType>PHY_RES_OTHR</SubAssetType>
```

```

    <AggregatedValueAmount>4657823</AggregatedValueAmount>
  </AIFMPrincipalInstrument>
- <AIFMPrincipalInstrument>
  <Ranking>5</Ranking>
  <SubAssetType>SEC_SSP_CMBS</SubAssetType>
  <AggregatedValueAmount>12569</AggregatedValueAmount>
</AIFMPrincipalInstrument>
</AIFMPrincipalInstruments>

<AUMAmountInEuro>300000001</AUMAmountInEuro>
- <AIFMBaseCurrencyDescription>
  <BaseCurrency>EUR</BaseCurrency>
  <AUMAmountInBaseCurrency>300000001</AUMAmountInBaseCurrency>
</AIFMBaseCurrencyDescription>

</AIFMCompleteDescription>
</AIFMRecordInfo>
</AIFMReportingInfo>

```

V. Kommentierte Version der AIFM-Meldung:

		Text des XML	Verweis auf Anhang IV	Kommentierung / Anmerkungen
		<pre> <?xml version="1.0" encoding="UTF-8" ?> <AIFMReportingInfo xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xsi:noNamespaceSchemaLocation="AIFMD_DATMAN_V1.2.xsd" ReportingMemberState="DE" Version="1.2" CreationDateAndTime="2015-03-02T12:42:41"> </pre>		<p>Reporting Member State: Staat, an den der AIFM den Report sendet, bei Meldung an die BaFin immer DE</p> <p>Version: Version der verwendeten XSD-Datei, bis auf weiteres ist Version 1.2 zu verwenden.</p> <p>Creation Date and Time: Zeitpunkt der Dateigenerierung; Hinweis: muss bei zweiter Einreichung derselben Datei manuell geändert werden, um Verwerfung der Datei als Dublette zu vermeiden. Es wird dadurch allerdings keine Reihenfolge für die Verarbeitung festgelegt. Diese wird ausschließlich durch den Zeitpunkt der Übermittlung des Dokumentes an die BaFin bestimmt.</p>
		<pre> - <AIFMRecordInfo> <FilingType>INIT</FilingType> </pre>		<p>INIT: Erstmaliges Reporting für den Meldezeitraum</p> <p>AMND: Erneute Einreichung zu einem bereits übermittelten Meldung; Die Abgabe von AMND Dokumenten ist auch ohne vorheriges INIT Dokument möglich.</p>
		<pre> <AIFMContentType>1</AIFMContentType> </pre>		<p>1: Meldung nach Art. 24 Abs. 1 für alle verwalteten AIF</p> <p>2: Meldung nach Art. 3 Abs. 3 d) für alle verwalteten AIF (betrifft KVG'en mit Registrierung)</p> <p>3: Meldungen nach Art. 24 Abs. 1 für alle AIF's, die in Deutschland vertrieben werden.</p>

		<ReportingPeriodStartDate>2014-10-01</ReportingPeriodStartDate> <ReportingPeriodEndDate>2014-12-31</ReportingPeriodEndDate>	Start- und Enddatum des Berichtszeitraums. Im Kontext ist dabei die Angabe im Feld ReportingPeriodType zu berücksichtigen. Erforderliches Format: YYYY-MM-DD
		<ReportingPeriodType>Q4</ReportingPeriodType>	Zulässige Werte: Für quartalsweise Berichterstattung: „Q1“, „Q2“, „Q3“, „Q4“ Für halbjährliche Berichterstattung: „H1“, „H2“ Für jährliche Berichterstattung: „Y1“ Sonderfälle: „X1“: Für 1. – 3. Quartal bei Wechsel der Berichtsperiode „X2“: Für 2. – 4. Quartal bei Wechsel der Berichtsperiode Innerhalb eines Jahres dürfen keine Überlappungen entstehen, kombinierbar sind nur: Q1-Q2-Q3-Q4; Q1-Q2-H2; Q1-X2; H1-H2; H1-Q3-Q4; Y1; X1-Q4 Hinweis: Im Falle einer Änderung der Berichtsperiode sind ergänzend die Datenfelder <AIFMReportingObligationChangeFrequencyCode>, <AIFMReportingObligationChangeContentsCode> und <AIFMReportingObligationChangeQuarter> zu befüllen. Beachten Sie hierzu auch Tabellen 8 und 10 von Anhang II von ESMA/2014/869DE.
		<ReportingPeriodYear>2014</ReportingPeriodYear>	Jahr des Berichtszeitraums, 4-stellig; Gültige Wertige: das aktuelle Kalenderjahr bzw. bis maximal zwei Jahre zurückliegend (als Bsp. für das aktuelle Jahr sind dies die Jahre 2015, 2014 u. 2013)
		<LastReportingFlag>>false</LastReportingFlag>	True: Für die letzte Meldung, wenn keine Folgemeldungen mehr abgegeben werden. In diesem Fall zwingend auf true zu setzen, da andernfalls weitere Meldungen erwartet und ggfs. bei Ihnen angemahnt werden. false: Falls weitere Meldungen folgen werden.
		- <Assumptions> - <Assumption> <QuestionNumber>1</QuestionNumber> <AssumptionDescription>TEST</AssumptionDescription> </Assumption> </Assumptions>	<QuestionNumber>: Nummer der Frage, auf die sich die Anmerkung / Annahme bezieht. <AssumptionDescription>: Beschreibung der Annahmen, Freitext, 300 Zeichen. Block ist optional und bietet Raum für Anmerkungen zum Datenbestand.
		<AIFMReportingCode>5</AIFMReportingCode>	Status des AIFM: 1: Registrierter AIFM nach Art. 3 2: AIFM mit Erlaubnis (opt-in) nach Art. 7 3: AIFM mit Erlaubnis und nur ungehebelten AIF, die in nicht börsennotierte Firmen und Emittenten mit dem Ziel der Kontrollübernahme nach Art. 7 investieren (Private Equity) 4: AIFM mit Erlaubnis und halbjährlicher Meldepflicht nach Art. 7 5: AIFM mit Erlaubnis und quartalsweiser Meldepflicht nach Art. 7 6: Non-EU-AIFM unter dem Private Placement Regime nach Art. 42 mit jährlicher Meldepflicht 7: Non-EU-AIFM unter dem Private Placement Regime nach Art. 42 mit ungehebelten AIF; die in nicht börsennotierte Firmen und Emittenten mit dem Ziel der Kontrollübernahme investieren (Private Equity) 8: Non-EU-AIFM unter dem Private Placement Regime nach Art. 43 mit halbjährlicher Meldepflicht 9: Non-EU-AIFM unter dem Private Placement Regime nach Art. 43 mit quartalsweiser Meldepflicht

		<AIFMJurisdiction>DE</AIFMJurisdiction>		Herkunftsland des AIFM gem. ISO-Code 3166-1
		<AIFMNationalCode>10XXXXX</AIFMNationalCode>		BaFin-ID der KVG
		<AIFMName>NAME</AIFMName>		Vollständiger Name der KVG gem. Erlaubniserteilung bzw. gem. LEI
		<AIFMEEAFlag>>true</AIFMEEAFlag>		true: AIFM hat seinen Sitz innerhalb des EWR false: AIFM hat seinen Sitz außerhalb des EWR
		<AIFMNoReportingFlag>>false</AIFMNoReportingFlag>		Standardwert: false True, wenn für den Meldezeitraum keine Daten zu AIF vorliegen, etwa weil noch keine aufgelegt wurden. In diesem Fall entfällt der Block AIFM Complete Description.
		- <AIFMCompleteDescription>		
		- <AIFMIdentifier> <AIFMIdentifierLEI>LEI1234567890123456789</AIFMIdentifierLEI> <AIFMIdentifierBIC>TESTDE20XXX</AIFMIdentifierBIC> </AIFMIdentifier>		LEI bzw. BIC des AIFM; Sofern LEI oder BIC sich ändern sind bei der darauf folgenden Meldung zusätzlich die Datenfelder <ReportingMemberState> und <AIFMNationalCode> in den Block aufzunehmen und mit den bisher gültigen Daten bzw. der Länderkennung zu befüllen. Die Prüfsumme des LEI wird durch die BaFin geprüft.
		- <AIFMPrincipalMarkets>		
		- <AIFMFivePrincipalMarket> <Ranking>1</Ranking> - <MarketIdentification> <MarketCodeType>MIC</MarketCodeType> <MarketCode>XMUN</MarketCode> </MarketIdentification> <AggregatedValueAmount>3657723241</AggregatedValueAmount> </AIFMFivePrincipalMarket>	A1 (bis A5)	Identifikation der wichtigsten Märkte, in denen der AIFM für die AIF handelt. Block ist für 5x (für jeden der 5 wichtigsten Märkte) zu wiederholen, Wert im Feld <Ranking> steigt entsprechend von 1 bis 5 an. Sortierung absteigend entsprechend Wert im Feld <AggregatedValueAmount> <MarketCodeTypes>: <ul style="list-style-type: none"> • „MIC“ sofern für den Markt ein MIC-Code existiert • „OTC“ für OTC-Transaktionen • XXX für Instrumente, die auf keinem spezifischen Markt gehandelt werden • „NOT“, sofern für den Rang kein Markt berichtet wird. <MarketCode> ist entsprechend ISO 10383 zu befüllen und entfällt für andere >MarketCodeTypes< als „MIC“ <AggregatedValueAmount>: Über alle AIF hinweg aggregierter Wert der Assets, die am entsprechenden Markt gehandelt werden; Angabe ohne Dezimalstellen in der <BaseCurrency> des AIFM per letztem Arbeitstag der Reporting Period; Entfällt für <MarketCodeTypes> = „NOT“.
		</AIFMPrincipalMarkets>		
		- <AIFMPrincipalInstruments>		
		- <AIFMPrincipalInstrument> <Ranking>1</Ranking> <SubAssetType>PHY_RES_COML</SubAssetType> <AggregatedValueAmount>3210283231</AggregatedValueAmount> </AIFMPrincipalInstrument>	B1 (bis B5)	Identifikation der wichtigsten Asset-Klassen, in denen der AIFM für die AIF handelt. Block ist für 5x (für jede der 5 wichtigsten Asset-Klassen) zu wiederholen, Wert im Feld <Ranking> steigt entsprechend von 1 bis 5 an. Sortierung absteigend entsprechend Wert im Feld <AggregatedValueAmount>. <SubAssetType>: Die zulässigen Werte ergeben sich aus Annex II, Tabelle 1 von ESMA/2014/869DE, es soll der höchste verfügbare Detaillierungsgrad verwendet werden. Handelt der AIFM in weniger als 5 Instrumentenarten, so sind die leer bleibenden Ränge hier mit dem Wert „NTA_NTA_NOTA“ zu versehen.

				<AggregatedValueAmount>: Über alle AIF hinweg aggregierter Wert der Assets der entsprechenden Asset-Klasse; Angabe ohne Dezimalstellen in der <BaseCurrency> des AIFM; Berechnung per letztem Arbeitstag der Reporting Period. Entfällt sofern ein Rang nicht genutzt wird.
		</AIFMPrincipalInstruments>		
		<AUMAmountInEuro>300000001</AUMAmountInEuro>	D	Verwaltete Vermögenswerte in Euro, berechnet gem. Art. 2
		- <AIFMBaseCurrencyDescription> <BaseCurrency>EUR</BaseCurrency> <AUMAmountInBaseCurrency>300000001</AUMAmountInBaseCurrency> </AIFMBaseCurrencyDescription>	C	Angabe der Basiswährung des AIFM gem. ISO 4217; Betrag aller verwalteten Vermögenswerte in der der Basiswährung ohne Dezimalstellen. Hinweis: Sofern die Basiswährung nicht auf EUR lautet sind ergänzend die Datenfelder <FXEURReferenceRateType> (Werte: „ECB“, sofern der Referenzkurs der Währung von der EZB veröffentlichte wird, sonst „OTH“) und <FXEURRate> (Referenzkurs, 4 Dezimalstellen) auszufüllen. Diese sollten in der Multiplikation identisch mit dem Euro-Wert sein. Sofern <FXEURReferenceRateType> den Wert „OTH“ enthält ist ergänzend Datenfeld <FXEUROtherReferenceRateDescription> zu befüllen. Hier ist in Freitext die Quelle des Wechselkurses einzutragen, sofern nicht EZB-Kurse verwendet werden.
		</AIFMCompleteDescription> </AIFMRecordInfo> </AIFMReportingInfo>		

VI. Kontakt & technischer Support:

Für alle Fragen, die im Zusammenhang mit dem Reporting stehen, können Sie sich an das AIFMD-Support Team der BaFin wenden.

WICHTIG: Wir haben bereits während der Phase 1 des Industrietests eine Vielzahl verschiedener Anfragen erhalten. Uns stehen aber nur sehr beschränkte personelle Ressourcen zur Abarbeitung dieser Anfragen zur Verfügung. Stellen Sie daher bitte vor Versendung einer Anfrage sicher, dass Sie sowohl die einschlägigen ESMA-Dokumente als auch das BaFin-Merkblatt (einschließlich Anlagen) in der jeweils aktuellen Fassung gelesen haben. Die inhaltlichen Vorgaben für das Reporting wurden durch ESMA definiert und sind europaweit einheitlich zu interpretieren. Haben Sie daher bitte Verständnis dafür, dass wir Anfragen zur Interpretation des Dateninhaltes, die sich nicht bereits aus den ESMA-Dokumenten ergeben, nur in sehr beschränktem Umfang beantworten können. Insbesondere während der Testphase werden wir uns daher zunächst auf die Lösung technischer Probleme fokussieren.

WICHTIG: Bitte tragen Sie unbedingt in die Betreffzeile Ihrer E-Mail das zu Ihrer KVG gehörende Aktenzeichen ein. Dieses setzt sich aus dem die Fachaufsicht über Ihr Haus führenden Referat, Ihrer BaFin-ID, dem Namen der KVG und weiteren festen Bestandteilen zusammen.

Syntax:

<Referat> - Wp 6048 – <BaFin-ID> - 2015/0001 / <Name>

Beispiel:

WA 44 – Wp 6048 – 10101234 – 2015/0001 / Invest GmbH

Technische Dienstleister, deren Anfrage sich auf mehrere KVG'en beziehen, verwenden als zuständiges Referat bitte die Bezeichnung „WA 4“ und können die BaFin-ID zunächst leer lassen.

Sofern sich Ihre Frage auf die Rückmeldung des BaFin-Systems zu einer von Ihnen hochgeladenen Datei bezieht, geben Sie bitte soweit bekannt in Ihrer E-Mail mit an, zu welchem Zeitpunkt (Datum & Uhrzeit) Sie die Datei hochgeladen haben und zu welchem Zeitpunkt (Datum & Uhrzeit) die Feedback-Datei vom System bereit gestellt worden ist.

Sie erleichtern uns hierdurch die Zuordnung Ihrer Anfrage sehr.

Richten Sie Ihre Mail bitte unter strikter Beachtung meiner vorstehenden Ausführungen ausschließlich an Support-AIFMD-Report@bafin.de.

Nur für Fehler, die beim Dateiupload entstehen, diesen verhindern oder den technischen Zugang zur MVP betreffen, wenden Sie sich bitte unter MVP-Support@bafin.de an den MVP-Support der BaFin.