

Frankfurt, 06.07.2015
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 AIF-Meldung im XML-Format

I. Inhalt

- I. Inhalt
- II. Allgemeine Anmerkungen
- III. Auszug aus der delegierten Verordnung
- IV. Unkommentiertes Beispiel einer erfolgreichen AIF-Meldung
- V. Kommentierte Version der AIF-Meldung
- VI. Kontakt & technischer Support

II. Allgemeine Anmerkungen

Bitte beachten Sie zunächst die erforderliche gz-Komprimierung und die Dateinamenskennung entsprechend unserem Merkblatt. Bitte beachten Sie, dass pro KVG nur EINE AIF-Datei gemeldet werden darf, die die Daten aller meldepflichtigen Fonds enthalten muss. Die Meldung einzelner Dateien pro Fonds ist nicht zulässig. Zur Integration mehrerer Fonds in die Datei fügen Sie unmittelbar nach dem Header der Datei für jeden Fonds einen eigenen Block <AIFRecordInfo> ein, der die Daten des jeweils zu meldenden Fonds enthält.

Für jede eingereichte Meldung wird immer eine weitere XML-Datei durch die BaFin als Antwort (Feedback-Datei) erzeugt, welche zum Download im MVP-Portal bereitgestellt wird. Dies geschieht zumeist zeitnah, kann aber insbesondere nach Anbindung 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 AIFErrorReference) und eine Beschreibung in Englisch (XML-Element AIFErrorMessage) 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.

Bitte beachten Sie, dass eine den Vorgaben entsprechende, erfolgreiche Meldung Ihrer Fonds erst dann gegeben ist, wenn das System Ihnen in der zuvor beschriebenen Weise die positiv verlaufene Überprüfung Ihrer Datei bestätigt. Die von der MVP bereits zuvor ausgegebene Rückmeldung über den reinen Upload der Datei (diese erhalten Sie unmittelbar nach dem Upload) genügt hierfür nicht.

Die von uns kommentierte Version der AIF-Meldung ist stets zusammen mit unserem Merkblatt und ESMA 2014/869 zu lesen. Unser Merkblatt finden Sie in der jeweils aktuellen Fassung auf der Webpage der BaFin. Das ESMA Dokument finden Sie hier: http://www.esma.europa.eu/system/files/esma_2014_00040000_de_cor.pdf

In technischer Hinsicht können die folgenden ESMA-Dokumente ebenfalls hilfreich sein:

<http://www.esma.europa.eu/content/AIFMD-reporting-IT-technical-guidance-rev-4-updated>

Betreffend die Dateninhalte empfehlen wir, den Q&A von ESMA zu konsultieren. Da dieser von ESMA regelmäßig aktualisiert wird, haben wir hier von einer Verlinkung abgesehen.

III. Auszug aus Anhang IV der delegierten Verordnung

Nicht-amtliche Anmerkungen und Kommentare der BaFin haben wir in **grün** hinterlegt. Das amtliche Original können Sie hier abrufen:
<http://eur-lex.europa.eu/LexUriServ/LexUriServ.do?uri=OJ:L:2013:083:0001:0095:DE:PDF>

Formblatt für die Berichterstattung: AIF

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

Angaben zum AIF

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

Datentyp		Gemeldete Daten	
Identität des AIF			
1	Name des AIF		EU-AIF: Ja/Nein
2	Fondsmanager (Firmenname und Standardcode, sofern verfügbar)		EU-AIFM: Ja/Nein
3	Identifikationscodes der Fonds, falls zutreffend		
4	Auflegedatum des AIF		
5	Sitz des AIF		
6	Identität des/der Primebroker des AIF (Firmenname und Standardcode, sofern verfügbar)		
7	Basiswährung des AIF nach ISO 4217 und verwaltete Vermögenswerte, berechnet gemäß Artikel 2	Währung	Gesamtwert des verwalteten Vermögens
8	Rechtsordnungen der drei wichtigsten Finanzierungsquellen (ohne von Anlegern gekaufte AIF-Anteile)		

9	Vorherrschender AIF-Typ (bitte einen Typ auswählen)	Hedgefonds HFND Private Equity-Fonds PEQF Immobilienfonds REST Dachfonds FOFS Sonstige OTHR Keine NONE	
10	Aufschlüsselung der Anlagestrategien (Aufschlüsselung der AIF-Anlagestrategien nach dem in Frage 1 genannten vorherrschenden AIF-Typ. Zur Beantwortung dieser Frage, siehe Erläuterungen.)		
		Angabe der Strategie, die die AIF-Strategie am besten beschreibt	Anteil am NAV (%)
a) Hedgefondsstrategien (Diese Frage ist zu beantworten, wenn unter Frage 1 als vorherrschender AIF-Typ „Hedgefonds“ angegeben wurde)			
Angabe der Hedgefondsstrategien, die die AIF-Strategien am besten beschreiben Equity: Long Bias Equity: Long/Short Equity: Marktneutral Equity: Short Bias Relative Value: Fixed Income Arbitrage Relative Value: Wandelanleihen-Arbitrage Relative Value: Volatilitätsarbitrage Event Driven: Krisensituationen/Restrukturierungen Event Driven: Risikoarbitrage (Risk Arbitrage/Merger Arbitrage) Event Driven: Equity – Special-Situations-Strategie Kredit (long/short) Asset Based Lending Makro Managed Futures/CTA: Fundamental		EQTY_LGBS EQTY_LGST EQTY_MTNL EQTY_STBS RELV_FXIA RELV_CBAR RELV_VLAR EVDR_DSRS EVDR_RAMA EVDR_EYSS CRED_LGST CRED_ABLG MACR_MACR MANF_CTAF	

Managed Futures/CTA: Quantitative	MANF_CTAQ	
Multi-Strategy-Hedgefonds	MULT_HFND	
sonstige Hedgefondsstrategien	OTHR_HFND	
<i>b) Private-Equity-Strategien</i> (Diese Frage ist zu beantworten, wenn unter Frage 1 als vorherrschender AIF-Typ „Private Equity-Fonds“ angegeben wurde)		
Angabe der Private-Equity-Strategien, die die AIF-Strategien am besten beschreiben		
Wagniskapital	VENT_CAPL	
Growth Capital	GRTH_CAPL	
Mezzanine-Kapital	MZNE_CAPL	
Multi-Strategy-Private-Equity	MULT_PEQF	
sonstige Private-Equity-Strategien	OTHR_PEQF	
<i>c) Immobilienstrategien</i> (Diese Frage ist zu beantworten, wenn unter Frage 1 als vorherrschender AIF-Typ „Immobilienfonds“ angegeben wurde)		
Angabe der Immobilienstrategien, die die AIF-Strategien am besten beschreiben		
Wohnimmobilien	RESL_REST	
Gewerbeimmobilien	COML_REST	
Industrieimmobilien	INDL_REST	
Multi-Strategy-Immobilienfonds	MULT_REST	
sonstige Immobilienstrategien	OTHR_REST	
<i>d) Dachfondsstrategien</i> (Diese Frage ist zu beantworten, wenn unter Frage 1 als vorherrschender AIF-Typ „Dachfonds“ angegeben wurde)		
Angabe der „Dachfondsstrategie“, die die AIF-Strategien am besten beschreibt		
Dach-Hedgefonds	FOFS_FHFS	
Dach-Private-Equity-Fonds	FOFS_PRIV	
sonstige Dachfonds	OTHR_FOFS	

e) Sonstige Strategien (Diese Frage ist zu beantworten, wenn unter Frage 1 als vorherrschender AIF-Typ „Sonstige“ angegeben wurde)			
Angabe der „sonstigen“ Strategie, die die AIF-Strategien am besten beschreibt			
Rohstoff-Fonds		OTHR_COMF	
Equity-Fonds		OTHR_EQYF	
Fixed Income-Fonds		OTHR_FXIF	
Infrastrukturfonds		OTHR_INFF	
sonstige Fonds		OTHR_OTHF	
Wichtigste Risiken und stärkste Konzentration			
11	Wichtigste Instrumente, mit denen der AIF handelt		
	Art/Code des Instruments	Wert (berechnet nach Artikel 3 AIFM-Richtlinie)	Long-/Short-Position
	Wichtigstes Instrument		
	Zweitwichtigstes Instrument		
	Drittwichtigstes Instrument		
	Viertwichtigstes Instrument		
	Fünftwichtigstes Instrument		
12	Geografischer Schwerpunkt		
	Geografische Aufschlüsselung der vom AIF gehaltenen Investitionen als prozentualer Anteil am gesamten Nettobestandswert (NAV) des AIF	% des NAV	AUM
	Afrika		
	Asien und pazifischer Raum (außer Mittlerer Osten)		
	Europa (EWR)		
	Europa (nicht EWR)		
	Mittlerer Osten		
	Nordamerika		
	Südamerika		
	Supranational/mehrere Regionen		

13	10 wichtigste Risiken des AIF zum Berichtsdatum (höchster absoluter Wert):						
		Art der Vermögenswerte/Verbindlichkeiten	Name/Beschreibung der Vermögenswerte/Verbindlichkeiten	Wert (berechnet nach Artikel 3)	% am Bruttomarktwert	Long-/Short-Position	Gegenpartei (sofern relevant)
	1.						
	2.						
	3.						
	4.						
	5.						
	6.						
	7.						
	8.						
	9.						
10.							
14	5 wichtigste Portfoliokonzentrationen:						
		Art der Vermögenswerte/Verbindlichkeiten	Name/Beschreibung des Markts	Höhe des aggregierten Risikos (berechnet nach Artikel 3)	% am Bruttomarktwert	Long-/Short-Position	Gegenpartei (sofern relevant)
	1.						
	2.						
	3.						
	4.						
5.							
15	Typische Geschäfts-/Positionsgröße (Diese Frage ist zu beantworten, wenn unter Frage 1 als vorherrschender AIF-Typ „Private Equity-Fonds“ angegeben wurde)			(bitte eine Angabe) Sehr klein Klein Unteres mittleres Marktsegment Oberes mittleres Marktsegment Large Cap Mega Cap	V_SMALL SMALL LOW_MID_MKT UP_MID_MKT L_CAP M_CAP		

16	Wichtigste Märkte, auf denen der AIF handelt		
	Angabe von Name und Kennnummer (z.B. MIC-Code), sofern verfügbar, des Markts mit dem höchsten Risiko		
	Angabe von Name und Kennnummer (z.B. MIC-Code), sofern verfügbar, des Markts mit dem zweithöchsten Risiko		
	Angabe von Name und Kennnummer (z.B. MIC-Code), sofern verfügbar, des Markts mit dem dritthöchsten Risiko		
17	Anlegerkonzentration		
	Angabe des ungefähren Prozentsatzes des AIF-Kapitals im wirtschaftlichen Eigentum der fünf wirtschaftlichen Eigentümer mit der höchsten Kapitalbeteiligung am AIF (als Prozentsatz der ausstehenden AIF-Anteile; Look-Through auf wirtschaftliche Eigentümer, sofern bekannt/möglich)		
	Aufschlüsselung der Anlegerkonzentration nach Anlegerstatus (Schätzwert, falls keine exakten Informationen verfügbar):		%
	– Professionelle Kunden (im Sinne der Richtlinie 2004/39/EG (MiFID)): – Kleinanleger:		

Geldwerte sind in der Basiswährung des AIF anzugeben.

IV. Unkommentiertes Beispiel einer erfolgreichen AIF-Meldung:

Doppelte Absätze dienen der übersichtlicheren Darstellung der Gliederung und sind nicht in die XML-Datei zu übernehmen. Der 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 („Editor“) öffnen und die enthaltenen Daten mit den Werten Ihres Hauses überschreiben. Die Verwendung von MS Word empfehlen wir hierfür nicht.

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8" ?>
<AIFReportingInfo Version="1.2" xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
xsi:noNamespaceSchemaLocation="AIFMD_DATAIF_V1.2.xsd" ReportingMemberState="DE" CreationDateAndTime="2015-04-09T10:00:00">

<AIFRecordInfo>
  <FilingType>INIT</FilingType>
  <AIFContentType>1</AIFContentType>
  <ReportingPeriodStartDate>2014-07-01</ReportingPeriodStartDate>
  <ReportingPeriodEndDate>2014-12-31</ReportingPeriodEndDate>
  <ReportingPeriodType>H2</ReportingPeriodType>
  <ReportingPeriodYear>2014</ReportingPeriodYear>
  <LastReportingFlag>>false</LastReportingFlag>

  <Assumptions>
    <Assumption>
      <QuestionNumber>64</QuestionNumber>
      <AssumptionDescription>TEXT</AssumptionDescription>
    </Assumption>
    <Assumption>
      <QuestionNumber>100</QuestionNumber>
      <AssumptionDescription>TEXT</AssumptionDescription>
    </Assumption>
  </Assumptions>

  <AIFMNationalCode>10XXXXXX</AIFMNationalCode>
  <AIFNationalCode>70XXXXXX</AIFNationalCode>
  <AIFName>NAME</AIFName>
  <AIFEEAFlag>>true</AIFEEAFlag>
  <AIFReportingCode>14</AIFReportingCode>
  <AIFDomicile>DE</AIFDomicile>
  <InceptionDate>2010-05-07</InceptionDate>
  <AIFNoReportingFlag>>false</AIFNoReportingFlag>

```

```
<AIFCompleteDescription>
  <AIFPrincipalInfo>

    <AIFIdentification>
      <AIFIdentifierLEI>LEI12345678901234567</AIFIdentifierLEI>
      <AIFIdentifierISIN>TEST20DEXXX4</AIFIdentifierISIN>
    </AIFIdentification>
    <ShareClassFlag>>false</ShareClassFlag>

  <AIFDescription>
    <AIFMasterFeederStatus>NONE</AIFMasterFeederStatus>

    <PrimeBrokers>
      <PrimeBrokerIdentification>
        <EntityName>XXX</EntityName>
        <EntityIdentificationLEI>LEI12345678901234567</EntityIdentificationLEI>
      </PrimeBrokerIdentification>
    </PrimeBrokers>

    <AIFBaseCurrencyDescription>
      <BaseCurrency>EUR</BaseCurrency>
      <AUMAmountInBaseCurrency>56325</AUMAmountInBaseCurrency>
    </AIFBaseCurrencyDescription>

    <AIFNetAssetValue>56325</AIFNetAssetValue>

    <FirstFundingSourceCountry>DE</FirstFundingSourceCountry>
    <SecondFundingSourceCountry>DE</SecondFundingSourceCountry>
    <ThirdFundingSourceCountry>DE</ThirdFundingSourceCountry>

    <PredominantAIFType>PEQF</PredominantAIFType>

    <PrivateEquityFundInvestmentStrategies>
      <PrivateEquityFundInvestmentStrategy>
        <PrivateEquityFundStrategyType>VENT_CAPL</PrivateEquityFundStrategyType>
        <PrimaryStrategyFlag>>true</PrimaryStrategyFlag>
        <StrategyNAVRate>100</StrategyNAVRate>
      </PrivateEquityFundInvestmentStrategy>
    </PrivateEquityFundInvestmentStrategies>
  </AIFDescription>
</AIFPrincipalInfo>
</AIFCompleteDescription>
```

```
</AIFDescription>
<MainInstrumentsTraded>
  <MainInstrumentTraded>
    <Ranking>1</Ranking>
    <SubAssetType>CIU_NAM_OTHR</SubAssetType>
    <InstrumentCodeType>ISIN</InstrumentCodeType>
    <InstrumentName>NAME</InstrumentName>
    <ISINInstrumentIdentification>DE20TESTXXX3</ISINInstrumentIdentification>
    <PositionValue>58125</PositionValue>
    <PositionType>L</PositionType>
  </MainInstrumentTraded>
  <MainInstrumentTraded>
    <Ranking>2</Ranking>
    <SubAssetType>CIU_NAM_OTHR</SubAssetType>
    <InstrumentCodeType>ISIN</InstrumentCodeType>
    <InstrumentName>NAME</InstrumentName>
    <ISINInstrumentIdentification>DE21TESTXXX1</ISINInstrumentIdentification>
    <PositionValue>12424</PositionValue>
    <PositionType>L</PositionType>
  </MainInstrumentTraded>
  <MainInstrumentTraded>
    <Ranking>3</Ranking>
    <SubAssetType>CIU_NAM_OTHR</SubAssetType>
    <InstrumentCodeType>ISIN</InstrumentCodeType>
    <InstrumentName>NAME</InstrumentName>
    <ISINInstrumentIdentification>FR30TESTXXX2</ISINInstrumentIdentification>
    <PositionValue>10254</PositionValue>
    <PositionType>L</PositionType>
  </MainInstrumentTraded>
  <MainInstrumentTraded><Ranking>4</Ranking><SubAssetType>NTA_NTA_NOTA</SubAssetType></MainInstrumentTraded>
  <MainInstrumentTraded><Ranking>5</Ranking><SubAssetType>NTA_NTA_NOTA</SubAssetType></MainInstrumentTraded>
</MainInstrumentsTraded>

<NAVGeographicalFocus>
  <AfricaNAVRate>0</AfricaNAVRate>
  <AsiaPacificNAVRate>0</AsiaPacificNAVRate>
  <EuropeNAVRate>0</EuropeNAVRate>
  <EEANAVRate>0</EEANAVRate>
  <MiddleEastNAVRate>0</MiddleEastNAVRate>
```

```
<NorthAmericaNAVRate>0</NorthAmericaNAVRate>
<SouthAmericaNAVRate>0</SouthAmericaNAVRate>
<SupraNationalNAVRate>100</SupraNationalNAVRate>
</NAVGeographicalFocus>

<AUMGeographicalFocus>
  <AfricaAUMRate>0</AfricaAUMRate>
  <AsiaPacificAUMRate>0</AsiaPacificAUMRate>
  <EuropeAUMRate>0</EuropeAUMRate>
  <EEAAUMRate>0</EEAAUMRate>
  <MiddleEastAUMRate>0</MiddleEastAUMRate>
  <NorthAmericaAUMRate>0</NorthAmericaAUMRate>
  <SouthAmericaAUMRate>0</SouthAmericaAUMRate>
  <SupraNationalAUMRate>100</SupraNationalAUMRate>
</AUMGeographicalFocus>

<PrincipalExposures>
  <PrincipalExposure>
    <Ranking>1</Ranking>
    <AssetMacroType>CIU</AssetMacroType>
    <SubAssetType>CIU_NAM_OTHR</SubAssetType>
    <PositionType>L</PositionType>
    <AggregatedValueAmount>58125</AggregatedValueAmount>
    <AggregatedValueRate>66.96</AggregatedValueRate>
  </PrincipalExposure>
  <PrincipalExposure>
    <Ranking>2</Ranking>
    <AssetMacroType>CIU</AssetMacroType>
    <SubAssetType>CIU_NAM_MMFC</SubAssetType>
    <PositionType>L</PositionType>
    <AggregatedValueAmount>14424</AggregatedValueAmount>
    <AggregatedValueRate>16.83</AggregatedValueRate>
  </PrincipalExposure>
  <PrincipalExposure>
    <Ranking>3</Ranking>
    <AssetMacroType>SEC</AssetMacroType>
    <SubAssetType>SEC_CSH_OTHD</SubAssetType>
    <PositionType>L</PositionType>
    <AggregatedValueAmount>14025</AggregatedValueAmount>
    <AggregatedValueRate>16.21</AggregatedValueRate>
```

```
</PrincipalExposure>
<PrincipalExposure><Ranking>4</Ranking><AssetMacroType>NTA</AssetMacroType></PrincipalExposure>
<PrincipalExposure><Ranking>5</Ranking><AssetMacroType>NTA</AssetMacroType></PrincipalExposure>
<PrincipalExposure><Ranking>6</Ranking><AssetMacroType>NTA</AssetMacroType></PrincipalExposure>
<PrincipalExposure><Ranking>7</Ranking><AssetMacroType>NTA</AssetMacroType></PrincipalExposure>
<PrincipalExposure><Ranking>8</Ranking><AssetMacroType>NTA</AssetMacroType></PrincipalExposure>
<PrincipalExposure><Ranking>9</Ranking><AssetMacroType>NTA</AssetMacroType></PrincipalExposure>
<PrincipalExposure><Ranking>10</Ranking><AssetMacroType>NTA</AssetMacroType></PrincipalExposure>
</PrincipalExposures>
```

```
<MostImportantConcentration>
  <PortfolioConcentrations>
    <PortfolioConcentration>
      <Ranking>1</Ranking>
      <AssetType>CIU_NAM</AssetType>
      <PositionType>L</PositionType>
      <MarketIdentification>
        <MarketCodeType>MIC</MarketCodeType>
        <MarketCode>XINV</MarketCode>
      </MarketIdentification>
      <AggregatedValueAmount>58125</AggregatedValueAmount>
      <AggregatedValueRate>66.96</AggregatedValueRate>
    </PortfolioConcentration>
    <PortfolioConcentration>
      <Ranking>2</Ranking>
      <AssetType>CIU_NAM</AssetType>
      <PositionType>L</PositionType>
      <MarketIdentification>
        <MarketCodeType>MIC</MarketCodeType>
        <MarketCode>XETA</MarketCode>
      </MarketIdentification>
      <AggregatedValueAmount>14424</AggregatedValueAmount>
      <AggregatedValueRate>16.83</AggregatedValueRate>
    </PortfolioConcentration>
    <PortfolioConcentration>
      <Ranking>3</Ranking>
      <AssetType>SEC_CSH</AssetType>
      <PositionType>L</PositionType>
      <MarketIdentification>
        <MarketCodeType>XXX</MarketCodeType>
```

```
        </MarketIdentification>
        <AggregatedValueAmount>14025</AggregatedValueAmount>
        <AggregatedValueRate>16.21</AggregatedValueRate>
    </PortfolioConcentration>
    <PortfolioConcentration><Ranking>4</Ranking><AssetType>NTA_NTA</AssetType></PortfolioConcentration>
    <PortfolioConcentration><Ranking>5</Ranking><AssetType>NTA_NTA</AssetType></PortfolioConcentration>
</PortfolioConcentrations>

<TypicalPositionSize>V_SMALL</TypicalPositionSize>

<AIFPrincipalMarkets>
    <AIFPrincipalMarket>
        <Ranking>1</Ranking>
        <MarketIdentification>
            <MarketCodeType>MIC</MarketCodeType>
            <MarketCode>XINV</MarketCode>
        </MarketIdentification>
        <AggregatedValueAmount>58125</AggregatedValueAmount>
    </AIFPrincipalMarket>
    <AIFPrincipalMarket>
        <Ranking>2</Ranking>
        <MarketIdentification>
            <MarketCodeType>MIC</MarketCodeType>
            <MarketCode>XETA</MarketCode>
        </MarketIdentification>
        <AggregatedValueAmount>14424</AggregatedValueAmount>
    </AIFPrincipalMarket>
    <AIFPrincipalMarket>
        <Ranking>3</Ranking>
        <MarketIdentification>
            <MarketCodeType>XXX</MarketCodeType>
        </MarketIdentification>
        <AggregatedValueAmount>14025</AggregatedValueAmount>
    </AIFPrincipalMarket>
</AIFPrincipalMarkets>

<InvestorConcentration>
    <MainBeneficialOwnersRate>100</MainBeneficialOwnersRate>
    <ProfessionalInvestorConcentrationRate>100</ProfessionalInvestorConcentrationRate>
    <RetailInvestorConcentrationRate>0</RetailInvestorConcentrationRate>
```

</InvestorConcentration>

</MostImportantConcentration>

</AIFPrincipalInfo>

</AIFCompleteDescription>

</AIFRecordInfo>

</AIFReportingInfo>

V. Kommentierte Version der AIF-Meldung:

Text des XML	Verweis auf Anhang IV	Kommentierung / Anmerkung
<pre><?xml version="1.0" encoding="UTF-8" ?> <AIFReportingInfo Version="1.2" xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xsi:noNamespaceSchemaLocation="AIFMD_DATAIF_V1.2.xsd" ReportingMemberState="DE" CreationDateAndTime="2015-04-09T10:00:00"></pre>		<p>Bitte auf die korrekte Übernahme des Datei-Headers achten!</p> <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 Version 1.2</p> <p>CreationDateAndTime: Zeitpunkt der Dateigenerierung; <u>Hinweis</u>: muss bei zweiter Einreichung derselben Datei manuell geändert werden, um Verwerfung als Dublette zu vermeiden. Die Reihenfolge der Datei-Verarbeitung richtet sich nach dem Zeitpunkt des Uploads in die MVP.</p>
<pre><AIFRecordInfo> <FilingType>INIT</FilingType></pre>		<p>INIT: Erstmaliges Reporting für den Meldezeitraum AMND: Erneute Einreichung zu einer bereits übermittelten Meldung; Die Abgabe von AMND Dokumenten ist auch ohne vorheriges INIT Dokument möglich.</p>
<pre><AIFContentType>1</AIFContentType></pre>		<ul style="list-style-type: none"> - 1 for "24(1) reporting obligation" - 2 for "24(1) + 24(2) reporting obligation" - 3 for "3(3) (d) reporting obligation" - 4 for "24(1) + 24(2) + 24(4) reporting obligation" - 5 for "24(1) + 24(4) reporting obligation"
<pre><ReportingPeriodStartDate>2014-07-01</ReportingPeriodStartDate> <ReportingPeriodEndDate>2014-12-31</ReportingPeriodEndDate></pre>		<p>Start- und Enddatum des Berichtszeitraums. Im Kontext ist dabei die Angabe im Feld ReportingPeriodType zu berücksichtigen. Erforderliches Format: YYYY-MM-DD; beachten Sie bitte die ergänzenden Ausführungen im Merkblatt und ESMA 2014/869, insbesondere bei der Neuauflage von Fonds.</p>
<pre><ReportingPeriodType>H2</ReportingPeriodType></pre>		<p>Zulässige Werte: Für quartalsweise Berichterstattung: „Q1“, „Q2“, „Q3“, „Q4“ Für halbjährliche Berichterstattung: „H1“, „H2“ Für jährliche Berichterstattung: „Y1“</p> <p>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</p> <p>Hinweis: Im Falle einer Änderung der Berichtsperiode sind ergänzend die Datenfelder <AIFMReportingObligationChangeFrequencyCode>, <AIFMReportingObligationChangeContentsCode> und <AIFMReportingObligationChangeQuarter> zu befüllen.</p>
<pre><ReportingPeriodYear>2014</ReportingPeriodYear></pre>		<p>Jahr des Berichtszeitraums, 4-stellig</p>
<pre><LastReportingFlag>>false</LastReportingFlag></pre>		<p>false: Falls weitere Meldungen folgen werden.</p> <p>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. Dies gilt auch bei der Übertragung des AIF auf einen anderen AIFM oder Fusionierung.</p>

<pre> <Assumptions> <Assumption> <QuestionNumber>64</QuestionNumber> <AssumptionDescription>TEXT</AssumptionDescription> </Assumption> </Assumptions> </pre>			<p><QuestionNumber>: Nummer des Datenblocks , zu dem Anmerkungen zu machen sind; Verwenden Sie bitte den Zahlenwert aus Anhang 4 der Delegierten Verordnung, dort Spalte 1 (siehe oben).</p> <p><AssumptionDescription>: Erläuterung zum Datenfeld in Freitext; vorzugsweise in englischer Sprache</p> <p>Block <Assumption> kann beliebig oft wiederholt werden.</p>
<pre> <AIFMNationalCode>10XXXXXX</AIFMNationalCode> <AIFNationalCode>XXXXXXXX</AIFNationalCode> <AIFName>NAME</AIFName> </pre>			<p><AIFMNationalCode>: BaFin-ID der KVG; beginnt in der Regel mit 10... oder 40...</p> <p><AIFNationalCode>: BaFin-Fonds-ID; beginnt in der Regel mit 70... Hinweis: intern verwaltete Gesellschaften verfügen über sowohl eine BaFin-ID als KVG als auch eine Fonds-ID als AIF; die Werte können beim die Fachaufsicht führenden Referat der BaFin erfragt werden. Bei Änderung der Fonds-ID bitte Anmerkung zum Datenblock <AIFidentification> beachten.</p> <p>Bei ausländischen Fonds sind die von der Heimatbehörde ausgegebenen Werte einzutragen.</p>
<pre> <AIFEEAFlag>>true</AIFEEAFlag> </pre>			<p>true: AIFM hat seinen Sitz innerhalb des EWR false: AIFM hat seinen Sitz außerhalb des EWR</p>
<pre> <AIFReportingCode>14</AIFReportingCode> </pre>			<p>Codes gem. Annex II Tabelle 9 von ESMA 2014/869: http://www.esma.europa.eu/content/Tables-8-9-10-Annex-2-ESMA-guidelines-AIFMD-reporting-obligation-revised</p>
<pre> <AIFDomicile>DE</AIFDomicile> </pre>			<p>Herkunftsland des AIFM gem. ISO-Code 3166-1</p>
<pre> <InceptionDate>2010-05-07</InceptionDate> </pre>			<p>Zeitpunkt, zu dem der AIF den Geschäftsbetrieb aufnimmt, i.d.R. Fondsauflegung / Handelsregistereintrag nach vorheriger Erlaubnis/Genehmigung; Format: YYYY-MM-DD; liegt zeitlich nie gleich oder nach dem Beginn der Reporting Periode, vgl. hierzu Anm. zu <ReportingPeriodStartDate></p>
<pre> <AIFNoReportingFlag>>false</AIFNoReportingFlag> </pre>			<p>Standardwert: false True, wenn für den Meldezeitraum keine Daten zu AIF vorliegen, etwa weil vom AIFM noch keine AIF aufgelegt wurden. In diesem Fall entfällt der Block AIF Complete Description.</p>
<pre> <AIFCompleteDescription> <AIFPrincipalInfo> </pre>			
<pre> <AIFIdentification> <AIFIdentifizierLEI>LEI12345678901234567</AIFIdentifizierLEI> <AIFIdentifizierISIN>TEST20DEXXX4</AIFIdentifizierISIN> <AIFIdentifizierCUSIP>1234</AIFIdentifizierCUSIP> <AIFIdentifizierSEDOL>1234</AIFIdentifizierSEDOL> <AIFIdentifizierTicker>1234</AIFIdentifizierTicker> <AIFIdentifizierRIC>1234</AIFIdentifizierRIC> <AIFIdentifizierECB>1234</AIFIdentifizierECB> </AIFIdentification> </pre>			<p>Identifikationskennziffern des AIF; von wesentlicher Bedeutung sind insbesondere LEI und ISIN. Die Prüfsumme des LEI wird durch die BaFin geprüft. Wichtiger Hinweis: für Fonds mit Anteilklassen ist die technische ISIN des Fonds einzutragen, diese beginnt im Regelfall mit „XC...“ (Datenfeld GD388PI im WM Datenservice).</p> <p>Sofern vorhanden / bekannt sollen für den AIF zusätzlich folgende Datenfelder aufgenommen und befüllt werden: CUSIP Code, SEDOL Code, Bloomberg Code, Reuters Code, ECB Code</p> <p>Sofern die BaFin-Fonds-ID (bzw. bei ausländischen Fonds der National Identifier) sich ändert, sind hier ergänzend bei der auf die Änderung folgenden Meldung zusätzlich die Datenfelder <ReportingMemberState> und <AIFMNationalCode> in den Block aufzunehmen und mit den bisher gültigen FondsID und der Länderkennung zu befüllen.</p>

<pre><ShareClassFlag>>false</ShareClassFlag></pre>			<p>„False“ für Fonds ohne Anteilklassen, „true“ für Fonds mit Anteilklassen; Fonds mit Anteilklassen müssen ergänzend die folgenden Datenfelder befüllen:</p> <pre><ShareClassNationalCode> FondsID – Die BaFin vergibt keine gesonderten BaFin-Fonds-ID's für Anteilklassen, Feld entfällt daher für AntKl. deutscher Fonds <ShareClassIdentifierISIN> ISIN der Anteilklasse, besonders wichtig bei Anteilklassenfonds <ShareClassIdentifierSEDOL> - SEDOL Code der Anteilklasse <ShareClassIdentifierCUSIP> - CUSIP Code der Anteilklasse <ShareClassIdentifierTicker> - Bloomberg Code der Anteilklasse <ShareClassIdentifierRIC> - Reuters Code der Anteilklasse <ShareClassName> - Name der Anteilklasse</pre>						
<pre><AIFDescription></pre>									
<pre><AIFMasterFeederStatus>NONE</AIFMasterFeederStatus></pre>			<p>Zulässige Werte: NONE / MASTER / FEEDER</p> <p>Sofern es sich um einen Feeder-Fonds handelt sind ergänzend folgende Datenfelder aufzunehmen: <pre><AIFName> - Name des Masterfonds <ReportingMemberState> - Domizil des Masterfonds <AIFNationalCode> National Identifier des Masterfonds, wird von der Heimataufsichtsbehörde des Masterfonds vergeben.</pre></p>						
<pre><PrimeBrokers> <PrimeBrokerIdentification> <EntityName>XXX</EntityName> <EntityIdentificationLEI>X</EntityIdentificationLEI> </PrimeBrokerIdentification> </PrimeBrokers></pre>			<p>Identifikationsdaten des Prime Brokers; Block <PrimeBrokerIdentification> wird für jeden Prime Broker wiederholt. Block <PrimeBrokers> entfällt komplett, wenn kein Prime Broker beauftragt ist.</p>						
<pre><AIFBaseCurrencyDescription> <BaseCurrency>EUR</BaseCurrency> <AUMAmountInBaseCurrency>56325</AUMAmountInBaseCurrency> </AIFBaseCurrencyDescription></pre>			<p>Währung in der der Fonds nominiert und Assets under Management in dieser Währung (ohne Dezimalstellen); sofern der Fonds nicht in EUR nominiert ist, sind ergänzend die folgenden Datenfelder aufzunehmen:</p> <pre><FXEURRate> - Umrechnungskurs <FXEURReferenceRateType> „ECB“, wenn Kurse der EZB zu Grunde gelegt werden, andernfalls „OTH“ <FXEUROtherReferenceRateDescription> Name der Wechselkursquelle, wenn kein EZB-Kurs verwendet wird (Freitext).</pre>						
<pre><AIFNetAssetValue>56325</AIFNetAssetValue></pre>			<p>Net Asset Value ohne Dezimalstellen.</p>						
<pre><FirstFundingSourceCountry>DE</FirstFundingSourceCountry> <SecondFundingSourceCountry>DE</SecondFundingSourceCountry> <ThirdFundingSourceCountry>DE</ThirdFundingSourceCountry></pre>			<p>Herkunftsstaaten der drei wichtigsten Finanzierungsquellen (Gegenparteien der Verbindlichkeiten); Finanzierung durch Anteilsausgabe / -verkauf bleibt unberücksichtigt.</p>						
<pre><PredominantAIFType>PEQF</PredominantAIFType></pre>			<p>Typologische Einordnung des AIF nach vorherrschender Anlagestrategie. Zulässige Werte:</p> <table border="0"> <tr> <td>PEQF – Private Equity Fonds</td> <td>HFND – Hedgefonds</td> </tr> <tr> <td>REST – Immobilienfonds</td> <td>FOFS – Dachfonds</td> </tr> <tr> <td>NONE – Keine vorherrschende Anlagestrategie</td> <td>OTHR – Sonstige</td> </tr> </table>	PEQF – Private Equity Fonds	HFND – Hedgefonds	REST – Immobilienfonds	FOFS – Dachfonds	NONE – Keine vorherrschende Anlagestrategie	OTHR – Sonstige
PEQF – Private Equity Fonds	HFND – Hedgefonds								
REST – Immobilienfonds	FOFS – Dachfonds								
NONE – Keine vorherrschende Anlagestrategie	OTHR – Sonstige								

HINWEIS: Der folgende Block variiert je nach Anlagestrategie des Fonds (Feld <PredominantAIFType>). Es ist **NUR** die zur jeweiligen Anlagestrategie passende Datenstruktur zu verwenden.

Allgemeine Erläuterungen zu den nachfolgenden Blöcken:

Der Block <...FundStrategy> wird bei verschiedenen Strategien mehrfach wiederholt, vgl. Beispiel bei „NONE“-Fonds unten.

Datenfelder <...StrategyType>: die zulässigen Codes entnehmen Sie bitte Anhang II, Tabelle 3 (Seite 40) von ESMA 2014/869. Mit Ausnahme der Fonds ohne vorherrschende Anlagestrategie (<PredominantAIFType> = "NONE") sollen nur Strategien gemeldet werden, die zur vorherrschenden Strategie passen, vgl. ESMA a.a.O.

<PrimaryStrategyFlag> - Wird für die primär verfolgte Investmentstrategie auf „true“ gesetzt, für alle anderen „false“. Wird eine der multiplen Anlagestrategien („MULT_HFND“, „MULT_PEQF“, „MULT_REST“) gemeldet, so ist diese stets die primäre Strategie.

<StrategyNAVRate> - Anteil der Strategie am NAV des Fonds in Prozent; Summe der Angaben muss exakt 100% ergeben. Die Angabe entfällt bei der Meldung multipler Anlagestrategien („MULT_HFND“, „MULT_PEQF“, „MULT_REST“) für den Block, der die multiple Strategie wiedergibt. Angabe mit 2 Dezimalstellen, negative Zahlen sind möglich.

Wird eine der sonstigen Anlagestrategien („OTHR_HFND“, „OTHR_PEQF“, „OTHR_REST“, „OTHR_FOFS“, „OTHR_OTHF“) gemeldet, so ist ergänzend das Datenfeld <StrategyTypeOtherDescription> aufzunehmen. Erforderlich ist eine Beschreibung der Strategie mittels Freitext, max. 300 Zeichen, wenn möglich in Englisch, vgl. Beispiel bei den Dachfonds unten.

Zusätzliche Meldeanforderung für High Frequency Trader: Wird im Rahmen einer Strategie High Frequency Trading eingesetzt, so sind ergänzend folgende Datenfelder zu befüllen:

<HFTTransactionNumber> - Zahl der im Rahmen des High Frequency Tradings ausgeführten Transaktionen gem. Definition in der MiFID II.

<HFTBuySellMarketValue> - Wert der im Rahmen des High Frequency Tradings erfolgten Käufe und Verkäufe für den Reportingzeitraum gem. Definition in der MiFID II (in der Währung des Fonds, ohne Dezimalstellen).

Falls für <RealEstateFundStrategyType> der Wert „MULT_REST“ angegeben wird, sollen mindestens 2 weitere Strategien angegeben werden.

Nur für Immobilienfonds "REST":

```
<RealEstateFundInvestmentStrategies>
  <RealEstateFundStrategy>
    <RealEstateFundStrategyType>COML_REST</RealEstateFundStrategyType>
    <PrimaryStrategyFlag>true</PrimaryStrategyFlag>
    <StrategyNAVRate>100.00</StrategyNAVRate>
  </RealEstateFundStrategy>
</RealEstateFundInvestmentStrategies>
```

<p><u>Nur für Privat Equity Fonds "PEQF":</u></p> <pre> <PrivateEquityFundInvestmentStrategies> <PrivateEquityFundInvestmentStrategy> <PrivateEquityFundStrategyType>VENT_CAPL</PrivateEquityFundStrategyType> <PrimaryStrategyFlag>true</PrimaryStrategyFlag> <StrategyNAVRate>100</StrategyNAVRate> </PrivateEquityFundInvestmentStrategy> </PrivateEquityFundInvestmentStrategies> </pre>			<p>Falls für <PrivateEquityFundStrategyType> der Wert „MULT_PEQF“ angegeben wird, sollen mindestens 2 weitere unterschiedliche Private Equity Strategien angegeben werden.</p>
<p><u>Nur für sonstige Fonds „OTHR“:</u></p> <pre> <OtherFundInvestmentStrategies> <OtherFundStrategy> <OtherFundStrategyType>OTHR_FXIF</OtherFundStrategyType> <PrimaryStrategyFlag>true</PrimaryStrategyFlag> <StrategyNAVRate>100</StrategyNAVRate> </OtherFundStrategy> </OtherFundInvestmentStrategies> </pre>			
<p><u>Nur für Hedgefonds „HFND“:</u></p> <pre> <HedgeFundInvestmentStrategies> <HedgeFundStrategy> <HedgeFundStrategyType>EVDR_DSRS</HedgeFundStrategyType> <PrimaryStrategyFlag>true</PrimaryStrategyFlag> <StrategyNAVRate>100</StrategyNAVRate> </HedgeFundStrategy> </HedgeFundInvestmentStrategies> </pre>			<p>Falls für <HedgeFundStrategyType> der Wert „MULT_HFND“ angegeben wird, sollen mindestens 2 weitere unterschiedliche Hedgefondsstrategien angegeben werden.</p>
<p><u>Nur für Dachfonds „FOFS“:</u></p> <pre> <FundOfFundsInvestmentStrategies> <FundOfFundsStrategy> <FundOfFundsStrategyType>OTHR_FOFS</FundOfFundsStrategyType> <PrimaryStrategyFlag>true</PrimaryStrategyFlag> <StrategyNAVRate>100.00</StrategyNAVRate> <StrategyTypeOtherDescription>Test</StrategyTypeOtherDescription> </FundOfFundsStrategy> </FundOfFundsInvestmentStrategies> </pre>			

<p><u>Nur für Fonds ohne vorherrschende Anlagestrategie "NONE":</u></p> <pre> <FundOfFundsInvestmentStrategies> <FundOfFundsStrategy> <FundOfFundsStrategyType>FOFS_FHFS</FundOfFundsStrategyType> <PrimaryStrategyFlag>true</PrimaryStrategyFlag> <StrategyNAVRate>60.00</StrategyNAVRate> </FundOfFundsStrategy> <FundOfFundsStrategy> <FundOfFundsStrategyType>FOFS_PRIV</FundOfFundsStrategyType> <PrimaryStrategyFlag>>false</PrimaryStrategyFlag> <StrategyNAVRate>40.00</StrategyNAVRate> </FundOfFundsStrategy> </FundOfFundsInvestmentStrategies> <OtherFundInvestmentStrategies> <OtherFundStrategy> <OtherFundStrategyType>OTHR_FXIF</OtherFundStrategyType> <PrimaryStrategyFlag>true</PrimaryStrategyFlag> <StrategyNAVRate>100.00</StrategyNAVRate> </OtherFundStrategy> </OtherFundInvestmentStrategies> </pre>			<p>Bei den AIF ohne vorherrschende Anlagestrategie (<PredominantAIFType> = „NONE“) können mehrere der zuvor benannten Strategien miteinander kombiniert werden. Ein mögliches Beispiel finden Sie hier.</p>
<p>Ende des Blocks zu den Anlagestrategien. Ab hier für alle Fonds einheitlich weiter.</p>			
<pre> </AIFDescription> </pre>			
<pre> <MainInstrumentsTraded> <MainInstrumentTraded> <Ranking>1</Ranking> <SubAssetType>CIU_NAM_OTHR</SubAssetType> <InstrumentCodeType>ISIN</InstrumentCodeType> <InstrumentName>NAME</InstrumentName> <ISINInstrumentIdentification>DE...</ISINInstrumentIdentification> <PositionValue>58125</PositionValue> <PositionType>L</PositionType> </MainInstrumentTraded> </MainInstrumentsTraded> </pre>			<p>In diesem Block werden die 5 wichtigsten Finanzinstrumente beschrieben, in denen der Fonds handelt. Für jedes der 5 wichtigsten Finanzinstrumente wird der Block <MainInstrumentTraded> (NICHT: <MainInstrumentsTraded> !!!) wiederholt. Hierbei steigt der Wert im Feld <Ranking> von 1 bis 5 an. Auf die Sortierreihenfolge ist zu achten. Rang 1 enthält den größten Wert im Feld <PositionValue>. Für die weiteren Ränge steigt der Wert im Feld <Ranking> jeweils um 1 an und der Wert im Feld <PositionValue> nimmt ab.</p> <p><SubAssetType> - die zulässigen Codes entnehmen Sie bitte Anhang II Tabelle 1 (Seite 36) von ESMA 2014/869. Handelt der AIF in weniger als 5 Instrumenten, so soll für die nicht genutzten Ränge der Wert "NTA_NTA_NOTA" verwendet werden. Für diese Ränge entfallen die nachfolgenden Detaildaten für die Finanzinstrumente.</p> <p><InstrumentCodeType> - Gibt die Art des verwendeten Identifizierungscodes für das gehandelte Instrument wieder; zulässige Werte: „ISIN“, „NONE“ (wenn das Instrument keinen Code hat) oder „AII“ (für Instrumente mit AII Code).</p>

			<p><InstrumentName> - Freitext, 300 Zeichen. Bezeichnung des Finanzinstruments nach Swift / ISO18774 wird empfohlen.</p> <p><ISINInstrumentIdentification> - Für den Regelfall eines Instruments mit ISIN wird hier die ISIN eingetragen. Entfällt bei der Verwendung eines anderen Identifizierungscodes.</p> <p>Sofern das Instrument über den AII-Code identifiziert wird, sind ergänzend folgende Datenfelder zu befüllen:</p> <p><AIIXchangeCode> - MIC Code des Instruments</p> <p><AIIProductCode> - AII exchange product code</p> <p><AIIDerivativeType> - "O" für Option, "F" für Future</p> <p><AIIPutCallIdentifier> - "P" für Put, "C" für Call, "F" bei einem Future</p> <p><AIIXpiryDate> - Fälligkeits- / Ausübungsdatum des Derivats</p> <p><AIIStrikePrice> - Ausübungspreis der Option, „0" für Futures</p> <p><PositonValue> - Wert des Instruments in Fondswährung</p> <p><PositionType> - „L" für long, „S" für short. Sofern es sich um eine Short-Position handelt, die als Hedge für eine gegenläufige Long-Position dient, ist ergänzend das Datenfeld <ShortPositionHedgingRate> mit aufzunehmen. Anzugeben ist der Wert der gegenläufigen Long-Position.</p>
<pre> <NAVGeographicalFocus> <AfricaNAVRate>0</AfricaNAVRate> <AsiaPacificNAVRate>0</AsiaPacificNAVRate> <EuropeNAVRate>0</EuropeNAVRate> <EEANAVRate>0</EEANAVRate> <MiddleEastNAVRate>0</MiddleEastNAVRate> <NorthAmericaNAVRate>0</NorthAmericaNAVRate> <SouthAmericaNAVRate>0</SouthAmericaNAVRate> <SupraNationalNAVRate>100</SupraNationalNAVRate> </NAVGeographicalFocus> </pre>			<p>Net Asset Value gegliedert nach Regionen als Prozentsatz. Summe der Werte muss genau 100 ergeben, Angabe mit 2 Dezimalstellen und negative Werte sind möglich.</p>
<pre> <AUMGeographicalFocus> <AfricaAUMRate>0</AfricaAUMRate> <AsiaPacificAUMRate>0</AsiaPacificAUMRate> <EuropeAUMRate>0</EuropeAUMRate> <EEAAUMRate>0</EEAAUMRate> <MiddleEastAUMRate>0</MiddleEastAUMRate> <NorthAmericaAUMRate>0</NorthAmericaAUMRate> <SouthAmericaAUMRate>0</SouthAmericaAUMRate> <SupraNationalAUMRate>100</SupraNationalAUMRate> </AUMGeographicalFocus> </pre>			<p>Asset under Management gegliedert nach Regionen als Prozentsatz mit 2 Dezimalstellen; Summe muss genau 100 ergeben.</p>

<pre> <PrincipalExposures> <PrincipalExposure> <Ranking>1</Ranking> <AssetMacroType>CIU</AssetMacroType> <SubAssetType>CIU_NAM_OTHR</SubAssetType> <PositionType>L</PositionType> <AggregatedValueAmount>58125</AggregatedValueAmount> <AggregatedValueRate>66.96</AggregatedValueRate> <CounterpartyIdentification> <EntityName>Name</EntityName> <EntityIdentificationLEI>TESTLEI</EntityIdentificationLEI> <EntityIdentificationBIC>TESTBIC</EntityIdentificationBIC> </CounterpartyIdentification> </PrincipalExposure> </PrincipalExposures> </pre>			<p>Anzugeben sind die 10 wichtigsten Risiken des AIF zum Meldestichtag. Hierfür wird der Block <PrincipalExposure> (NICHT: <PrincipalExposures> !!!) insgesamt 10 mal wiederholt. Mit jeder Wiederholung steigt der Wert im Feld <Ranking> um 1 an. Diese Reihenfolge ist einzuhalten. Die Risiken sind nach Ihrem Wert in absteigender Reihenfolge zu sortieren.</p> <p><AssetMacroType> Die zulässigen Werte entnehmen Sie bitte Anhang II, Tabelle 1 (Seite 36) von ESMA 2014/869. Hat der AIF weniger als 10 Risiken zu melden, so ist für jeden nicht genutzten Rang „NTA“ einzutragen. Die weiteren Daten zum Exposure entfallen dann für diesen Rang.</p> <p><SubAssetType> Die zulässigen Werte entnehmen Sie bitte ebenfalls Anhang II, Tabelle 1 (Seite 36) von ESMA 2014/869.</p> <p><PositionType> - „L“ für long, „S“ für short</p> <p><AggregatedValueAmount> Wert der gemeldeten Position(en) in der Basiswährung des Fonds ohne Dezimalstellen</p> <p><AggregatedValueRate> Wert der gemeldeten Position(en) in Prozent.</p> <p>Sofern das Risiko einer konkreten Gegenpartei zugeordnet werden kann, ist der Block <CounterpartyIdentification> mit aufzunehmen. Es soll der vollständige Name der Gegenpartei entsprechend der Registrierung beim LEI angegeben werden. Der Block entfällt, wenn das Risiko keiner konkreten Gegenpartei zugeordnet werden kann.</p>
<pre> <MostImportantConcentration> </pre>			
<pre> <PortfolioConcentrations> <PortfolioConcentration> <Ranking>1</Ranking> <AssetType>CIU_NAM</AssetType> <PositionType>L</PositionType> <MarketIdentification> <MarketCodeType>MIC</MarketCodeType> <MarketCode>XINV</MarketCode> </MarketIdentification> <AggregatedValueAmount>58125</AggregatedValueAmount> <AggregatedValueRate>66.96</AggregatedValueRate> <CounterpartyIdentification> <EntityName>Name</EntityName> <EntityIdentificationLEI>TESTLEI</EntityIdentificationLEI> <EntityIdentificationBIC>TESTBIC</EntityIdentificationBIC> </CounterpartyIdentification> </PortfolioConcentration> </PortfolioConcentrations> </pre>			<p>Anzugeben sind die 5 wichtigsten Portfoliokonzentrationen des AIF zum Meldestichtag. Hierfür wird der Block <PortfolioConcentration> (NICHT: <PortfolioConcentrations> !!!) insgesamt 5 mal wiederholt. Mit jeder Wiederholung steigt der Wert im Feld <Ranking> um 1 an. Diese Reihenfolge ist einzuhalten. Die Konzentrationen sind nach Ihrem Wert in absteigender Reihenfolge zu sortieren.</p> <p><AssetType> Die zulässigen Werte finden Sie in Anhang II, Tabelle 1 von ESMA 2014/869. Sind weniger als 5 Konzentrationen zu befüllen, so ist für nicht genutzte Ränge „NTA_NTA“ anzugeben. Die Detaildaten zur jeweiligen Konzentration entfallen dann.</p> <p><PositionType> - „L“ für long, „S“ für short</p> <p><MarketCodeType> „MIC“ für Märkte mit MIC-Code „OTC“ für OTC-Derivate „XXX“ bei nicht existentem Markt</p> <p><MarketCode> - MIC Code</p> <p><AggregatedValueAmount> - Wert in Fondswährung ohne Dezimalstellen</p> <p><AggregatedValueRate> - Wert in Prozent</p> <p>Sofern die Konzentration einer konkreten Gegenpartei zugeordnet werden kann, ist der Block <CounterpartyIdentification> mit aufzunehmen. Es soll der vollständige Name der Gegenpartei entsprechend der Registrierung beim LEI angegeben werden. Der Block entfällt, wenn die Konzentration keiner konkreten Gegenpartei zugeordnet werden kann</p>

<pre><TypicalPositionSize>V_SMALL</TypicalPositionSize></pre>			<p>Dieses Datenfeld gibt die typische Geschäfts- oder Positionsgröße an, falls es sich bei dem AIF um einen Private Equity-Fonds handelt (<PredominantAIFType> = „PEQF“). Es entfällt für andere Fondsarten.</p> <p>Zulässige Werte:</p> <ul style="list-style-type: none"> - "V_SMALL" (very small) für < 5 Mio. € - "SMALL" (small) zwischen 5 und 25 Mio. € - "LOW_MID_MKT" (Low mid market) zwischen 25 und 150 Mio. € - "UP_MID_MKT" (Upper mid market) zwischen 150 und 500 Mio. € - "L_CAP" (Large cap) zwischen 500 Mio. € und 1 Mrd. € - "M_CAP" (Mega cap) für > 1 Mrd. €
<pre><AIFPrincipalMarkets> <AIFPrincipalMarket> <Ranking>1</Ranking> <MarketIdentification> <MarketCodeType>MIC</MarketCodeType> <MarketCode>XINV</MarketCode> </MarketIdentification> <AggregatedValueAmount>58125</AggregatedValueAmount> </AIFPrincipalMarket> </AIFPrincipalMarkets></pre>			<p>Anzugeben sind die 3 wichtigsten Märkte, auf denen der AIF handelt. Hierfür wird der Block <AIFPrincipalMarket> (NICHT: <AIFPrincipalMarkets> !!!) insgesamt 3 mal wiederholt. Mit jeder Wiederholung steigt der Wert im Feld <Ranking> um 1 an. Diese Reihenfolge ist einzuhalten. Die Konzentrationen sind nach Ihrem Wert in absteigender Reihenfolge zu sortieren.</p> <p><MarketCodeType> Zulässige Werte:</p> <ul style="list-style-type: none"> - „MIC“ – für Märkte mit MIC-Code - „OTC“ für OTC-Derivate - „XXX“ für Transaktionen, die ohne Markt ausgeführt werden - „NOT“, falls für den Rang kein Markt mehr zu melden ist. <p><MarketCode> - MIC-Code des Marktes gem. ISO 10383</p> <p><AggregatedValueAmount> Aggregierter Wert der Instrumente in Fondswährung ohne Dezimalstellen</p>
<pre><InvestorConcentration> <MainBeneficialOwnersRate>100</MainBeneficialOwnersRate> <ProfessionalInvestorConcentrationRate>100</ProfessionalInvestorConcentrationRate> <RetailInvestorConcentrationRate>0</RetailInvestorConcentrationRate> </InvestorConcentration></pre>			<p>Angabe erfolgt in Prozent mit 2 Dezimalstellen. Summe der Werte muss exakt 100 ergeben.</p> <p><MainBeneficialOwnersRate> Angabe des Prozentsatzes des Kapitals, dass den 5 größten wirtschaftlichen Eigentümern gehört (Look-Through erwünscht; Angaben soweit bekannt)</p> <p><ProfessionalInvestorConcentrationRate> Anteil der Professionellen Kunden im Sinne von RL 2004/39/EG (MiFID) bzw. § 31a Abs. 2, 3 und 7 WpHG</p> <p><RetailInvestorConcentrationRate> Anteil an Kleinanlegern im Sinne von RL 2004/39/EG (MiFID) bzw. § 31a Abs. 2, 3 und 7 WpHG</p>
<pre></MostImportantConcentration></pre>			
<pre></AIFPrincipalInfo> </AIFCompleteDescription> </AIFRecordInfo> </AIFReportingInfo></pre>			

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 bislang bereits eine Vielzahl verschiedener Anfragen erhalten. Uns stehen aber nur sehr beschränkt 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 und zu Beginn der Produktivphase 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 bezieht, 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 bereitgestellt 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 Dateiapload 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.