

# Verordnung über die Meldepflichten beim Handel mit Wertpapieren und Derivaten (Wertpapierhandel-Meldeverordnung - WpHMV)

WpHMV

Ausfertigungsdatum: 21.12.1995

Vollzitat:

"Wertpapierhandel-Meldeverordnung vom 21. Dezember 1995 (BGBl. I S. 2094; 1996 I S. 220), die zuletzt durch Artikel 1 der Verordnung vom 18. Dezember 2007 (BGBl. I S. 3014) geändert worden ist"

**Stand:** Zuletzt geändert durch Art. 1 V v. 18.12.2007 I 3014

## Fußnote

(+++ Textnachweis ab: 31.12.1995 +++)

## Eingangsformel

Auf Grund des § 9 Abs. 3 und 4 und des § 41 Abs. 1 des Wertpapierhandelsgesetzes vom 26. Juli 1994 (BGBl. I S. 1749) in Verbindung mit § 1 der Verordnung zur Übertragung der Befugnis zum Erlaß von Rechtsverordnungen auf das Bundesaufsichtsamt für den Wertpapierhandel vom 16. März 1995 (BGBl. I S. 390) verordnet das Bundesaufsichtsamt für den Wertpapierhandel:

## Abschnitt 1 Anwendungsbereich

### § 1 Anwendungsbereich

Diese Verordnung gilt für die Mitteilungen nach § 9 des Wertpapierhandelsgesetzes an die Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (Bundesanstalt).

## Abschnitt 2 Form und Inhalt der Mitteilung

### § 2 Meldesatz

(1) Die zu Mitteilungen nach § 9 Abs. 1 des Wertpapierhandelsgesetzes verpflichteten Unternehmen (Meldepflichtige) haben für die Mitteilungen einen Meldesatz nach Maßgabe des anliegenden Meldebogens und der anliegenden Feldbeschreibung zu erstellen. Felder, die auf Grund von Art und Struktur des zu meldenden Geschäftes nicht benötigt werden, bleiben leer.

(2) Für jedes zu identifizierende Geschäft eines Meldepflichtigen darf jeweils nur ein Meldesatz übermittelt werden. Die Meldepflichtigen haben die an jeweils einem Tag abgegebenen Meldesätze mit einer laufenden Nummer zu versehen.

(3) Alle Zeitangaben haben stets in gleicher Form zu erfolgen. Ein Datum ist achtstellig in der Reihenfolge Jahrhundert, Jahr, Monat und Tag, die Uhrzeit sechsstellig in der Reihenfolge Stunden, Minuten und Sekunden anzugeben.

### § 3 Bezeichnung des Wertpapiers oder Derivats und Wertpapierkennnummer

(1) Das Finanzinstrument ist hinreichend, insbesondere durch Angabe von Art und Bezeichnung, zu beschreiben (Feld-Nr.: 30 und 35 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 10 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006).

(2) Die internationale Kennnummer des gehandelten Finanzinstruments ist anzugeben (Feld-Nr.: 31 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 6 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006). Gibt es keine internationale Kennnummer oder ist sie dem Meldepflichtigen nicht verfügbar, ist die deutsche Wertpapierkennnummer anzugeben (Feld-Nr.: 33); gibt es keine deutsche Wertpapierkennnummer, ist eine sonstige nationale Kennnummer anzugeben (Feld-Nr.: 33). Bei einer nationalen Kennnummer ist der Staat, aus dem die Kennnummer stammt, anzugeben (Feld-Nr.: 32 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 7 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006). Werden Derivate gehandelt, ist entweder das Feld „Internationale Kennnummer“ (Feld-Nr.: 31) mit der kontraktsspezifischen ISIN oder die Felder „Kennzeichen der Gattungsart“ (Feld-Nr.: 32) und „nationale Kennnummer“ (Feld-Nr.: 33) mit dem Produktcode des Derivates zu befüllen. Für alle Arten von Derivaten sind zusätzlich anzugeben:

1. Art des Derivats (Feld-Nr.: 39 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 12 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006);
2. Art der Identifikation des Underlying (Feld-Nr.: 40 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 9 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006);
3. Identifikation des Underlying (Feld-Nr.: 41 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 8 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006);
4. Preismultiplikator (Feld-Nr.: 42 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 15 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006);
5. Währung des Basispreises der Option (Feld-Nr.: 44 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 17 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006);
6. Basispreis der Option (Feld-Nr.: 45 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 14 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006);
7. Notierungsart des Basispreises (Feld-Nr.: 46);
8. Fälligkeit des Derivats (Feld-Nr.: 47 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 11 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006).

(3) (weggefallen)

#### **§ 4 Datum und Uhrzeit**

(1) Das Kalenderdatum des Geschäftsabschlusses oder der maßgeblichen Feststellung des Börsenpreises ist anzugeben (Feld-Nr. 13 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 2 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006).

(2) Die Uhrzeit des Geschäftsabschlusses oder der maßgeblichen Feststellung des Börsenpreises ist nach Stunden, Minuten und Sekunden anzugeben (Feld-Nr. 14 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 3 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006).

(3) Bei im Ausland abgeschlossenen Geschäften sind das Datum und die Uhrzeit des Geschäftsabschlusses in die jeweils im Inland geltende Zeit (mitteleuropäische Zeit oder mitteleuropäische Sommerzeit) umzusetzen.

#### **§ 5 Preis, Stückzahl, Nennbetrag der Wertpapiere oder Derivate**

(1) Die Menge, auf die der ausgeführte Auftrag oder das Geschäft lautet, ist anzugeben (Feld-Nr. 25 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 18 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006). Es ist zu erläutern, auf welche Einheit, beispielsweise Stück oder Kontrakte, sich diese Menge bezieht (Feld-Nr. 24 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 19 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006).

(2) Der auf das gemeldete Geschäft bezogene Börsen- oder sonstige Preis (Feld-Nr. 27 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 16 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006) ist unter Angabe der Einheit der Effektennotiz (Feld-Nr. 36) und der Handelswährung (Feld-Nr. 26 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 17 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006) anzugeben.

#### **§ 6 Identifikation der Beteiligten**

(1) Die Meldepflichtigen haben der Bundesanstalt Namen und Anschrift sowie, soweit vorhanden, die Kassenvereinsnummern, die deutsche Bankleitzahl, den Member-ID-Code eines elektronischen

Börsenhandelssystem (EBHS), den Bank Identifier Code nach ISO 9362 (BIC), den International Business Entity Identifier (IBEI) und die von der Gruppe Deutsche Börse vergebene interne Identifikationsnummer anzuzeigen. Jede Änderung dieser Daten ist der Bundesanstalt unverzüglich anzuzeigen.

(2) Die Meldepflichtigen erhalten nach Eingang der Anzeige nach Absatz 1 Satz 1 von der Bundesanstalt eine achtstellige Identifikationsnummer.

(3) Im Meldesatz haben die Meldepflichtigen für ihre Identifikation die Identifikationsnummer nach Absatz 2 oder eine der anderen in der Feldbeschreibung vorgesehenen Nummern in der dort festgelegten Reihenfolge anzugeben (Feld-Nr.: 2 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 1 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006). Die Art der Identifikation ist anzugeben (Feld-Nr.: 1).

(4) Für die Identifikation der an dem Geschäft als Kunde, Kontrahent, Makler oder Zwischenkommissionär beteiligten Meldepflichtigen gilt Absatz 3 entsprechend (Feld-Nr.: 3 bis 12 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 20 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006). Für die Identifikation von nicht meldepflichtigen Beteiligten gilt Satz 1 mit der Maßgabe, dass die Angabe freiwillig ist. Meldepflichtige im Sinne dieses Absatzes sind abweichend von § 2 Abs. 1 Satz 1 juristische und natürliche Personen, die der Meldepflicht nach § 9 Abs. 1 des Wertpapierhandelsgesetzes oder einer entsprechenden Vorschrift eines anderen Mitgliedstaates der Europäischen Union oder Vertragsstaates des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum unterliegen.

(5) Die Meldepflichtigen haben bei Geschäften, die sie für einen selbst nicht meldepflichtigen Depotinhaber tätigen, die Art der Identifikation anzugeben (Feld-Nr.: 3). Die Angabe muss eine Identifikation des Depotinhabers oder des Depots enthalten; die gewählte Art der Identifikation ist durchgängig zu verwenden. In beiden Fällen ist auch ein von dem Depotinhaber abweichender Auftraggeber zu kennzeichnen. Die Meldepflichtigen haben den Depotinhaber oder das Depot mit einer Ziffern- oder Buchstabenfolge zu kennzeichnen (Feld-Nr.: 4). Dabei muss eine eindeutige Zuordnung des verwendeten Kennzeichens zu einem bestimmten Depotinhaber oder Depot gewährleistet sein.

## **§ 7 Angaben zum Handel**

Es ist anzugeben, ob das Geschäft zu einem Börsenpreis abgeschlossen wurde (Feld-Nr.: 21). Außerdem ist anzugeben, an welchem Handelsplatz das Geschäft abgeschlossen wurde (Feld-Nr.: 23 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 21 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006) und gegebenenfalls in welchem Staat das Geschäft abgeschlossen worden ist (Feld-Nr.: 22).

## **§ 8 Kennzeichen zur Identifikation des Geschäfts**

Zur Identifikation des Geschäfts sind anzugeben:

1. eine vom Meldepflichtigen für jedes Geschäft, bei Teilgeschäften für dieses Teilgeschäft selbst vergebene, für den Meldepflichtigen und den Handelstag eindeutige interne Meldenummer (Feld-Nr. 15 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 22 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006);
2. ob es sich aus Kundensicht um einen Kauf oder um einen Verkauf handelt (Feld-Nr. 17 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 4 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006);
3. bei maklervermittelten und über die Börse abgewickelten Geschäften die Abruf-Gruppe-Makler (Feld-Nr. 60), die Angabe, ob es sich um ein Aufgabegeschäft handelt (Feld-Nr. 59) sowie die Geschäftsnummer und bei Änderung dieser Geschäftsnummer die ursprüngliche Geschäftsnummer (Feld-Nr.: 58);
4. im Feld „Geschäftstyp“ (Feld-Nr. 18), ob es sich um einen Bruttopreis, eine zusammengefasste Meldung nach § 16 oder eine zugrunde liegende interessewahrende Order handelt; falls im jeweiligen Handelssystem ein Transaktionsschlüssel vorhanden ist, ist dieser anzugeben;
5. das Valutatatum durch Bezeichnung des Kalendertages, an dem vereinbarungsgemäß die Geldverrechnung vorzunehmen ist (Feld-Nr. 51).

## **§ 9 Kennzeichen für Geschäfte auf eigene Rechnung**

Es ist zu kennzeichnen, ob bei dem Geschäft der Eigenbestand betroffen ist (Feld-Nr. 19 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 5 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006). Zudem ist anzugeben, ob es sich um ein Kunden- oder Eigengeschäft handelt (Feld-Nr. 20 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 5 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006).

## **§ 10 Zusätzliche Angaben**

Zusätzlich zu den in § 9 Abs. 2 des Wertpapierhandelsgesetzes vorgeschriebenen Angaben hat die Mitteilung folgende Angaben zu enthalten:

1. die laufende Nummer des Meldesatzes nach § 2 Abs. 2 Satz 2 (Feld-Nr. 54);
2. die Angabe des Melders (Feld-Nr. 55);
3. das letzte Rechenzentrum, das demjenigen der Bundesanstalt vorgeschaltet ist (Feld-Nr. 52).

Melder im Sinne des Satzes 1 Nr. 2 ist derjenige, der den Meldesatz erstellt hat.

## **§ 11 Fehlerhafte Mitteilungen**

Stellt der Meldepflichtige einen Fehler in der abgegebenen Mitteilung fest, hat er unverzüglich eine Stornierung entsprechend den Angaben des zu stornierenden Geschäfts unter Angabe des Stornodatum (Feld-Nr.: 48 in Verbindung mit Anhang I Tabelle 1 Feld Nr. 23 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006) zu melden. Eine anschließende erneute Mitteilung des Geschäfts ist zu kennzeichnen (Feld-Nr.: 50); hierbei muß die interne Meldenummer von dem unmittelbar zuvor gemeldeten Geschäft und Storno abweichen. Satz 2 gilt auch für weitere Meldungen eines Geschäfts.

## **Abschnitt 3 Übermittlung der Mitteilungen**

### **§ 12 Technisches Übermittlungsformat**

(1) Die Mitteilungen sind mit einer Übertragungsdatei im ASCII-Format zu übermitteln.

(2) Die Übertragungsdatei ist mit einem Namen von höchstens acht Zeichen zu versehen. Eine Datei kann mehrere Meldesätze enthalten. Die Datei muß mit einem Vorsatz beginnen und mit einem Nachsatz enden. Der Vorsatz ist wie folgt aufgebaut: Name der Übertragungsdatei; Datum der Erstellung der Übertragungsdatei; Zeit der Erstellung der Übertragungsdatei. Der Nachsatz ist wie folgt aufgebaut: Datum der Erstellung der Übertragungsdatei; Zeit der Erstellung der Übertragungsdatei; Anzahl der übertragenen Datensätze einschließlich des Vor- und des Nachsatzes.

(3) Die einzelnen Felder in den Datensätzen sind durch ein Semikolon zu trennen (ASCII-Code 59). Jeder Datensatz beginnt und endet ohne Semikolon. Die einzelnen Datensätze sind durch eine Zeilenschaltung zu trennen (ASCII-Code 13 und 10). Der Nachsatz endet ohne Zeilenschaltung. Ein leerer Datensatz am Ende einer Datei ist nicht zulässig.

### **§ 13 Zulässige Datenträger und Übertragungswege**

(1) Die Übertragungsdatei kann über eine Festverbindung oder über eine Mailbox übermittelt werden. Sofern diese Übertragungswege aufgrund technischer Schwierigkeiten im Einzelfall nicht zur Verfügung stehen, können als Datenträger auch Disketten (HD) 1,44 MB 3,5 Zoll, formatiert im DOS Format (Version 3.3 oder höher), verwendet werden.

(2) Eine Festverbindung zur Datenfernübertragung oder ein Verfahren über Mailbox zum Zwecke der Übertragung der Mitteilungen vom Meldepflichtigen oder einem Dritten an die Bundesanstalt kann nur mit Zustimmung der Bundesanstalt auf Kosten des Meldepflichtigen oder des Dritten eingerichtet werden. Die Bundesanstalt kann die Einrichtung einer Festverbindung oder eines Mailbox-Verfahrens ablehnen, wenn sich aus diesen Übertragungswegen für die Bundesanstalt unverhältnismäßige Kosten ergeben würden.

### **§ 14 Mitteilung über Dritte**

(1) Die Meldepflichtigen können die Mitteilungen auf ihre Kosten durch einen geeigneten Dritten abgeben. Geeignet ist ein Dritter, der die Datensicherheit und die Einhaltung der in § 9 Abs. 1 Satz 1 des Wertpapierhandelsgesetzes vorgeschriebenen Mitteilungsfrist gewährleistet. Die Bundesanstalt kann die mangelnde Eignung eines Dritten, die insbesondere bei wiederholt fehlerhaften oder verspäteten Mitteilungen anzunehmen ist, feststellen. Zuvor ist dem Dritten unter angemessener Fristsetzung Gelegenheit zur Abhilfe einzuräumen.

(2) Bei Einschaltung eines Dritten haben die Meldepflichtigen ihre Mitteilungspflicht erst dann erfüllt, wenn der Dritte die Mitteilung gegenüber der Bundesanstalt mit dem vollständig und richtig erstellten Meldesatz innerhalb der in § 9 Abs. 1 Satz 1 des Wertpapierhandelsgesetzes vorgeschriebenen Frist abgegeben hat.

## **§ 15 (weggefallen)**

-

## **Abschnitt 4 Zusammenfassung von Mitteilungen, Befreiungen**

### **§ 16 Zusammenfassung von Mitteilungen**

Festpreisgeschäfte eines Tages in zum Nennwert rückzahlbaren fest- oder variabel verzinslichen Schuldverschreibungen inländischer Emittenten, die zum gleichen Preis ausgeführt werden, können pro Wertpapier in zusammengefaßter Form mit einem Meldesatz gemeldet werden; in diesem Fall entfällt eine Meldung der Uhrzeit. Dasselbe gilt für Bezugsrechte, die ein Meldepflichtiger am letzten Tag des Bezugsrechtshandels für seine Kunden veräußert, wenn diese Geschäfte zum gleichen Preis ausgeführt werden, für Zuteilungen auf Grund von Zeichnungen sowie für Geschäfte im Rahmen von Daueremissionen des Bundes. Bei der Zusammenfassung von Mitteilungen kann eine Sammelkundenidentifizierung verwendet werden (Feld-Nr.: 4). Dies gilt auch für ausländische Meldepflichtige, die für einen nicht nach § 9 des Wertpapierhandelsgesetzes meldepflichtigen Kunden mit Sitz im Ausland tätig werden.

## **§ 17 (weggefallen)**

-

## **Abschnitt 5 Schlußvorschriften**

### **§ 18 Erstmalige Mitteilungs- und Anzeigepflicht**

(1) Die Mitteilungen müssen erstmals für die nach dem 31. Dezember 1995 abgeschlossenen Geschäfte abgegeben werden.

(2) (weggefallen)

### **§ 19 Inkrafttreten**

Diese Verordnung tritt am Tage nach der Verkündung in Kraft.

### **Anlage**

(Fundstelle: Anlageband zum BGBl. I 2007, Nr. 66 vom 21. Dezember 2007, Seite 1 bis 29)

Anlage