



eurex rundschriften 040/17

Datum: 3. Mai 2017
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendors
Autorisiert von: Dr. Randolph Roth



Aktion erforderlich



Hohe Priorität

MiFID II/MiFIR: Teilnehmer-Referenzdaten und Erweiterung der Orderdatensätze

Kontakt: Ihr Key Account Manager Trading oder regulatory.support@deutsche-boerse.com

Zielgruppe:

➡ Alle Abteilungen

Anhang (nur in Englisch):

Guide: Procedure to generate CONCAT

Zusammenfassung:

Die regulatorischen Änderungen der überarbeiteten „Markets in Financial Instruments-Richtlinie“ (MiFID II) und der begleitenden Verordnung „Markets in Financial Instruments Regulation“ (MiFIR) treten am **3. Januar 2018** in Kraft.

Zur Erfüllung ihrer Meldepflichten muss Eurex Deutschland als Handelsplatz zusätzliche Teilnehmer-Referenzdaten erfassen und die Informationen erweitern, die zusammen mit Order- und Quote-Transaktionen eingegeben werden müssen. Weiterhin muss Eurex Deutschland nach Artikel 7 des „regulatory technical standard“ (RTS) 7 eine jährliche Beurteilung ihrer Teilnehmer durchführen und einmal pro Jahr prüfen, ob die Teilnehmer noch als Wertpapierfirmen gemäß der Definition in Artikel 4 (1) der Richtlinie 2014/65/EU zugelassen sind. Mit diesem Rundschreiben informiert Eurex Deutschland ihre Teilnehmer über die erforderlichen Daten und die zusätzlichen Felder, die in diesem Zusammenhang in den Order- und Quote-Datensätzen in T7 hinzugefügt werden.



MiFID II/MiFIR: Teilnehmer-Referenzdaten und Erweiterung der Orderdatensätze**Überblick**

Um die Einhaltung der zum 3. Januar 2018 in Kraft tretenden MiFID II/MiFIR-Bestimmungen zu gewährleisten, muss Eurex Deutschland die Teilnehmer-Referenzdaten erweitern und in regelmäßigen Abständen eine risikobasierte Beurteilung ihrer zugelassenen Teilnehmer durchführen.

Eurex Deutschland ist als Handelsplatz verpflichtet, unter anderem die folgenden Daten zu erfassen und der jeweils zuständigen nationalen Behörde („National Competent Authority“, NCA) zugänglich zu machen:

Feld-nummer	Feld	Kurzbeschreibung
1	Identifikation des Unternehmens, das den Auftrag eingereicht hat	Identität des Teilnehmers des Handelsplatzes
-	-	-
3	Kunden-identifikationscode	Code zur Identifikation des Kunden des Teilnehmers
4	Anlageentscheidung innerhalb der Firma	Code zur Identifikation der Person oder des Algorithmus beim Teilnehmer, die oder der für die Anlageentscheidung vorrangig verantwortlich ist
5	Ausführung innerhalb der Firma	Identifikation der Person (Eurex-Händler) oder des Algorithmus beim Teilnehmer des Handelsplatzes, die oder der für die Transaktion (Ausführung der Order) verantwortlich ist

Tabelle 1: Auszug aus Tabelle 2, Anhang I zu RTS 24, welche die Felder definiert, die ein Handelsplatz aufzeichnen und der NCA zugänglich machen muss

Bei der Umsetzung der regulatorischen Anforderungen zur Aufzeichnung zusätzlicher Orderdaten ist Eurex Deutschland bestrebt, die Auswirkungen auf die Teilnehmer möglichst gering zu halten, indem Änderungen der bestehenden Order-/Quote-Formate auf das Notwendigste beschränkt werden. Anpassungen der Order-/Quote-Formate werden zudem den FIX-Standards entsprechen. Zusätzlich wird eine Lösung angeboten, die die Kodierung von Kunden- und Personenidentifikationscodes sowie die Pflege dieser Daten außerhalb des Handelssystems ermöglicht.

Neben der Verpflichtung, entsprechende Order-Daten aufzuzeichnen, muss Eurex Deutschland gemäß Artikel 48 (1) der Richtlinie 2014/65/EU und Artikel 7 der RTS 7 jährlich eine risikobasierte Beurteilung ihrer zugelassenen Teilnehmer durchführen.

Abschnitt 1 dieses Rundschreibens beschreibt die Teilnehmer-Referenzdaten auf, die Eurex Deutschland zusätzlich erheben muss, um die aufsichtsrechtlichen Meldepflichten sowie Due Diligence-Vorgaben zu erfüllen.

Abschnitt 2 beschreibt Format und Nutzung der neuen Felder, die mit dem kommenden T7 Release 6.0 (geplant für den 4. Dezember 2017) eingeführt werden, um die erforderlichen Informationen auf Einzelorderbasis zu erfassen.

1. Teilnehmer-Referenzdaten

1.1 LEI („Legal Entity Identifier“)-Codes der Teilnehmer

- **Regulatorische Anforderung**

Nach Artikel 25 (2) der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 und RTS 24 muss Eurex Deutschland entsprechende Daten zur Identifizierung des Teilnehmers des Handelsplatzes der jeweils zuständigen Behörde zugänglich machen. Zu diesem Zweck muss Eurex Deutschland den LEI („Legal Entity Identifier“) des Unternehmens melden, wie in Feld 1 „Identifikation des Unternehmens, das den Auftrag eingereicht hat“ im Anhang zu RTS 24, Tabelle 2, definiert. Die gleiche Anforderung gilt für Feld 4 „Identifikationscode der ausführenden Einrichtung“ im Anhang I zu RTS 22, Tabelle 2.

- **Allgemeines Format**

Der LEI, wie in Standard ISO 17442 definiert, enthält 20 alphanumerische Zeichen. LEIs werden genutzt, um rechtlich eigenständige Organisationseinheiten, die an Finanztransaktionen beteiligt sind, eindeutig zu identifizieren. LEIs werden von „Local Operating Units“ (LOUs) des „Global LEI System“ vergeben.

Weitere Informationen über den Bezug einer LEI können den folgenden Websites entnommen werden:

<http://www.leiirc.org/lei/how.htm> und <http://www.leiportal.org/>.

- **Übermittlung**

Der Zentrale Koordinator jedes Eurex-Handelsteilnehmers kann in der Member Section auf der Eurex-Website www.eurexchange.com unter „Benutzerverwaltung“ den Teilnehmer-LEI übermitteln und aktualisieren.

- **Frist für die Übermittlung**

Eurex-Teilnehmer sollten ihre LEIs bis spätestens 1. Dezember 2017 übermitteln, damit ihre Readiness gewährleistet ist. Außerdem müssen die Teilnehmer sicherstellen, dass ihre LEIs aktualisiert werden, da die LEIs jährlich durch die LOUs aktualisiert werden müssen.

1.2 „National ID“ für Händler der Eurex-Teilnehmer

- **Regulatorische Anforderung**

Nach Artikel 25 (2) der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 und RTS 24 muss Eurex Deutschland der jeweils zuständigen Behörde entsprechende Daten zur Identifizierung der Person beim Teilnehmer des Handelsplatzes zugänglich machen, die vorrangig für die Anlageentscheidung oder vorrangig für die Ausführung der Transaktion verantwortlich ist.

Die „National ID“ von zugelassenen Händlern bei den Teilnehmern ist eine der Möglichkeiten zur Befüllung von Feld 4 „Anlageentscheidung innerhalb der Firma“ oder Feld 5 „Ausführung innerhalb der Firma“ im Anhang zu RTS 24, Tabelle 2.

- **Allgemeines Format – National ID**

Für die National ID muss der Ländercode nach Standard ISO 3166-1 der Staatsangehörigkeit der Person mit der Kennung aus der folgenden Tabelle 1 (identisch mit der Tabelle 1 in Anhang II zu RTS 22) auf Basis der Staatsangehörigkeit der Person zusammengefügt werden.

- **CONCAT**

Eine der notwendigen Kennungen ist die „CONCAT ID“, die aus einer Aneinanderreihung („concatenation“) der folgenden Elemente in der angegebenen Reihenfolge besteht:

- a) Das Geburtsdatum der Person im Format JJJJMMTT
- b) Die ersten fünf Buchstaben des Vornamens und
- c) Die ersten fünf Buchstaben des Nachnamens

Bitte entnehmen Sie dem Dokument ESMA/2016/1452, Kapitel 5.5, weitere Details zu CONCAT.

- **Prioritäten der Kennungen**

Es muss die Kennung mit der höchsten Priorität, die den Teilnehmern vorliegt, verwendet werden. Wenn die Information mit der ersten Priorität nicht verfügbar ist, können andere Kennungen unter strikter Einhaltung der Prioritätsebenen, wie in der Tabelle angegeben, verwendet werden. Zum Beispiel müssen die Teilnehmer der Eurex Deutschland für Händler aus Großbritannien die Staatsangehörigkeit (GB) und die nationale Versicherungsnummer von Großbritannien (erste Priorität) melden. Wenn die nationale Versicherungsnummer nicht verfügbar ist, kann die Staatsangehörigkeit (GB) in Kombination mit der „CONCAT ID“ (zweite Priorität) übermittelt werden.

- **Händler mit mehr als einer Staatsangehörigkeit**

Wenn ein Händler mehr als eine Staatsangehörigkeit von Ländern des Europäischen Wirtschaftsraums (EWR) hat, wird die Länderkennung der ersten Staatsangehörigkeit nach der Sortierung entsprechend ihrem ISO 3166-1 alpha2-Code und die entsprechende Kennung der so ermittelten ersten Staatsangehörigkeit verwendet. Wenn eine natürliche Person eine Staatsangehörigkeit eines EWR-Staats und eine Staatsangehörigkeit eines Nicht-EWR-Staats hat, wird die Kennung der Staatsangehörigkeit des EWR-Staats verwendet.

Die folgende Tabelle beschreibt die Prioritäten der National IDs gemäß den regulatorischen Anforderungen:

Alpha-2-Code nach ISO 3166-1	Name des Landes	Erste Priorität	Zweite Priorität	Dritte Priorität
AT	Österreich	CONCAT		
BE	Belgien	Belgische nationale Nummer (Numéro de registre national – Rijksregisternummer)	CONCAT	
BG	Bulgarien	Bulgarische persönliche Nummer	CONCAT	
CY	Zypern	Nationale Passnummer	CONCAT	
CZ	Tschechische Republik	Nationale Identifikationsnummer (Rodné číslo)	Passnummer	CONCAT
DE	Deutschland	CONCAT		
DK	Dänemark	Persönlicher Identitätscode 10 alphanumerische Zeichen: DDMMYYXXXX	CONCAT	
EE	Estland	Estnischer persönlicher Identifikationscode (Isikukood)		
ES	Spanien	Steueridentifikationsnummer (Código de identificación fiscal)		
FI	Finnland	Persönlicher Identitätscode	CONCAT	
FR	Frankreich	CONCAT		
GB	Vereinigtes Königreich	Nationale Versicherungsnummer	CONCAT	

Alpha-2-Code nach ISO 3166-1	Name des Landes	Erste Priorität	Zweite Priorität	Dritte Priorität
GR	Griechenland	10-stelliger DSS Investor Share	CONCAT	
HR	Kroatien	Persönliche Identifikationsnummer (OIB – Osobni identifikacijski broj)	CONCAT	
HU	Ungarn	CONCAT		
IE	Irland	CONCAT		
IS	Island	Persönlicher Identitätscode (Kennitala)		
IT	Italien	Steuernummer (Codice fiscale)		
LI	Liechtenstein	Nationale Passnummer	Nationale Personalausweisnummer	CONCAT
LT	Litauen	Persönlicher Code (Asmens kodas)	Nationale Passnummer	CONCAT
LU	Luxemburg	CONCAT		
LV	Lettland	Persönlicher Code (Personas kods)	CONCAT	
MT	Malta	Nationale Identifikationsnummer	Nationale Passnummer	
NL	Niederlande	Nationale Passnummer	Nationale Personalausweisnummer	CONCAT
NO	Norwegen	11-stellige persönliche ID (Foedselsnummer)	CONCAT	
PL	Polen	Nationale Identifikationsnummer (PESEL)	Steuernummer (Numer identyfikacji podatkowej)	
PT	Portugal	Steuernummer (Número de Identificação Fiscal)	Nationale Passnummer	CONCAT
RO	Rumänien	Nationale Identifikationsnummer (Cod Numeric Personal)	Nationale Passnummer	CONCAT
SE	Schweden	Persönliche Kennnummer	CONCAT	
SI	Slowenien	Persönliche Identifikationsnummer (EMŠO: Enotna Matična Številka Občana)	CONCAT	
SK	Slowakei	Persönliche Nummer (Rodné číslo)	Nationale Passnummer	CONCAT
Alle anderen Länder		Nationale Passnummer	CONCAT	

Tabelle 2: Nationale Kundenidentifikationscodes für natürliche Personen (ESMA 2016/1064 RTS 22, Anhang II vom 1. Juli 2016)

• **Übermittlung**

- (1) Für bestehende Händler wird der Zentrale Koordinator jedes Eurex-Handelsteilnehmers eine Liste der aktuell an Eurex Deutschland zugelassenen Händler erhalten. Die Teilnehmer können anschließend die National ID-Daten für die bestehenden Händler eintragen und diese in Form einer CSV-Datei hochladen. Im Hinblick auf das Datum des Inkrafttretens der neuen Bestimmung ist geplant, die Funktion zum Hochladen bis 18. September 2017 zur Verfügung zu stellen.
- (2) Zum Pflegen der Informationen für einzelne Händler im Zulassungsprozess können sich die Teilnehmer in die Eurex Member Section einloggen und unter „Zulassungen und User IDs“ die Information eingeben oder die Funktion zum Hochladen nutzen. Diese Funktion steht bereits seit Februar 2017 zur Verfügung.

- **Frist für die Übermittlung – National IDs aller zugelassenen Händler**

Teilnehmer an Eurex Deutschland sollten die National IDs **aller ihrer zugelassenen Händler** bis spätestens **1. Dezember 2017** übermitteln, um ihre Readiness sicherzustellen. Händler, die nach diesem Datum zugelassen werden, müssen ihre National ID angeben, um den Zulassungsprozess erfolgreich abzuschließen.

Am 3. April 2017 hat die ESMA die Standards und Formate für die National ID (Referenz: ESMA70-1861941480-56) veröffentlicht. Weitere Details hierzu können der ESMA-Website unter diesem Link entnommen werden:

https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/esma70-1861941480-56_qas_mifir_data_reporting_0.pdf

1.3 Algo-Kennungen

- **Regulatorische Anforderung**

Nach Artikel 25 (2) der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 und RTS 24 muss Eurex Deutschland entsprechende Daten zur Identifizierung des Algorithmus der jeweils zuständigen Behörde zugänglich machen, der beim Teilnehmer des Handelsplatzes vorrangig für die Anlageentscheidung verantwortlich oder vorrangig für die Ausführung einer Transaktion verantwortlich ist. Daher ist die Algo-Kennung eine der Möglichkeiten für das Befüllen des Feldes 4 „Anlageentscheidung innerhalb der Firma“ oder des Feldes 5 „Ausführung innerhalb der Firma“ vom Anhang zu RTS 24, Tabelle 2.

Algo-Kennungen werden von den Teilnehmern ihren jeweiligen Algorithmen zugewiesen, die die Bestimmungen gemäß Artikel 48 (6) der Verordnung 2014/65/EU und Artikel 10 von RTS 7 erfüllen. Zur Entsprechung diesen Bestimmungen bittet Eurex Deutschland zur Vermeidung von Marktstörungen alle Teilnehmer, ihre Algorithmen in einer Testumgebung zu testen, bevor diese Algorithmen in der Produktion eingesetzt werden.

Eurex Deutschland wird den Teilnehmern die Möglichkeit bieten, ihre Algorithmen in der Standard-Simulationsumgebung zu testen. Vor der Einführung neuer Releases steht die Standard-Simulationsumgebung nur zum Testen der neuen Software-Version zur Verfügung. Besonders in dieser Phase können Handelsteilnehmer ihre Algorithmen auch in der aktuellen Produktionsversion in der Cloud-Simulation testen. Bitte entnehmen Sie weitere Details zum Cloud Simulation-Service der Eurex-Website www.eurexexchange.com unter dem folgenden Link:

[Technology > Eurex Exchange's T7 > Eurex T7 Cloud Simulation](#)

Die Teilnehmer müssen bestätigen, dass alle installierten Algorithmen die von den MiFID II-Bestimmungen geforderten Tests erfolgreich durchlaufen haben. Die Zertifikate zu den Algorithmen müssen die Algo-Kennung des Algorithmus, der getestet wurde, und den Namen des Handelsteilnehmers nennen, der den Algorithmus bei Eurex Deutschland registrieren lassen möchte.

- **Allgemeines Format**

Zertifizierung eines Algorithmus:

Die Teilnehmer müssen Zertifikate anlegen und diese hochladen. Die Details bezüglich der genutzten Dateiformate für das Hochladen werden derzeit von der FIX-Händler-Community ausgearbeitet. Die Einführung an Eurex Deutschland wird den FIX-Standards entsprechen.

- **Übermittlung**

Zertifizierung eines Algorithmus:

Eurex Deutschland plant, bis spätestens 18. September 2017 eine Upload-Funktion für alle Algorithmus-Zertifikate innerhalb der Eurex Member Section anzubieten. Die Teilnehmer können dann die Zertifikate gesammelt (CSV-Datei) oder einzeln hochladen.

- **Frist für die Übermittlung**

Zertifizierung eines Algorithmus:

Eurex-Teilnehmer sollten ihre Zertifikate bis spätestens 1. Dezember 2017 hochladen, um ihre Readiness sicherzustellen. Jede Algo-Kennung muss ein Zertifikat erhalten.

Zertifikate für neue Algorithmen müssen vor 23:30 Uhr MEZ an Tag T hochgeladen werden. Wenn ein Teilnehmer nicht bis zum Ende des Tages T, an dem eine Algo-Kennung mit einer Ordertransaktion gesendet wurde, ein Zertifikat für diese Algo-Kennung übermittelt, wird Eurex Deutschland am nächsten Handelstag den Teilnehmer über die unvollständigen Daten informieren. Der Teilnehmer muss sicherstellen, dass die Daten spätestens bis zum nächsten Handelstag (T+1) vor 23:30 Uhr MEZ vervollständigt werden.

1.4 Short Codes

1.4.1 Short Codes für Kundenidentifikationscodes

- **Regulatorische Anforderung**

Die Teilnehmer können für die Identifikationscodes, welche für die Identifikation ihrer direkten Kunden erforderlich sind, Short Codes vergeben. Nach Artikel 25 (2) der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 und Artikel 2 von RTS 24 muss Eurex Deutschland entsprechende Daten zur Identifizierung des Kunden des Mitglieds oder Teilnehmers des Handelsplatzes der jeweils zuständigen Behörde zugänglich machen. Es bestehen fünf Möglichkeiten, das Feld 3 „Kundenidentifikationscode“ aus Tabelle 2 des Anhangs zu RTS 24 zu befüllen:

- 1) wenn der Kunde eine juristische Person ist, mit dem LEI des Kunden
- 2) wenn der Kunde keine juristische Person ist, mit der National ID des Kunden
- 3) wenn es sich um eine aggregierte Order handelt, mit dem Kennzeichen AGGR¹
- 4) im Falle von ausstehenden Zuweisungen mit dem Kennzeichen PNAL²
- 5) Dieses Feld soll nur leer gelassen werden, wenn der Teilnehmer des Handelsplatzes auf eigene Rechnung handelt

Der „Kundenidentifikationscode“ bezieht sich auf direkte Kunden der Eurex-Teilnehmer. Teilnehmer sollen nur den LEI oder die National ID ihrer direkten Kunden angeben.

1.4.2 Short Codes für die Ausführungsentscheidung und die Anlageentscheidung

Es müssen außerdem Short Codes genutzt werden, wenn die Anlage- oder Ausführungsentscheidung von einer Person beim Teilnehmer getroffen wird, die kein zugelassener Eurex-Händler ist, oder in Fällen, wo die Anlageentscheidung von einem zugelassenen Eurex-Händler getroffen wird, die Ausführungsentscheidung jedoch von einem anderen Händler übermittelt wird. Wie in Artikel 2 (1)(b) von RTS 24 dargelegt, muss das Feld „Anlageentscheidung“ immer befüllt werden, wenn der Teilnehmer für eigene Rechnung handelt, da er

¹ Wie in Artikel 2 (3) der Delegierten Verordnung der Kommission zum Aufbewahren von einschlägigen Aufzeichnungen bezüglich Orders mit Finanzinstrumenten nach Artikel 25 (2) der Verordnung (EU) Nr. 600/2014

² Wie in Artikel 2 (2) der der Delegierten Verordnung der Kommission zum Aufbewahren von einschlägigen Aufzeichnungen bezüglich Orders mit Finanzinstrumenten nach Artikel 25 (2) der Verordnung (EU) Nr. 600/2014

seine eigenen Bücher einem Risiko aussetzt. Somit wird davon ausgegangen, dass er auch eine Anlageentscheidung trifft.

Das Feld „Ausführungsentscheidung“ sollte in jeder Transaktionsmeldung befüllt sein, wobei die folgenden Fälle zu unterscheiden sind: Die Ausführungsentscheidung wurde

- von einem Kunden getroffen (z. B. wenn der Kunde die Details des Geschäfts einschließlich des Handelsplatzes vorgibt). In diesem Fall wird der Standardwert „CLIENT“ (Short Code = 3) übermittelt.
- von einer Person beim Teilnehmer getroffen (entweder ein zugelassener Händler oder eine andere, nicht zugelassene Person, welche die Details für die Ausführung vorgegeben hat)
- durch einen Algorithmus herbeigeführt.

1.4.3 Übermittlung von Short Codes und Formaten

- **Übermittlung**

Die Teilnehmer können die Short Codes und die zugehörigen National IDs oder LEIs in der Eurex Member Section gesammelt oder einzeln hochladen. Die Details bezüglich der genutzten Dateiformate für das Hochladen werden derzeit von der FIX-Händler-Community ausgearbeitet. Die Einführung an Eurex Deutschland wird den FIX-Standards entsprechen. Es wird erwartet, dass die folgenden Standard-Short Codes reserviert werden:

- 0 – Kein Kunde für diese Order
- 1 – Kennzeichen für aggregierte Order „AGGR“
- 2 – Kennzeichen für ausstehende Zuweisungen „PNAL“
- 3 – „CLIENT“

Die richtige Nutzung der Short Codes wird im nächsten Kapitel 2 beschrieben.

- **Frist für die Übermittlung**

Eurex Deutschland muss die Short Codes und die zugehörigen Log-Codes sowie die entsprechenden Kennungen (National ID oder LEI) vor 23:30 Uhr MEZ an Tag T erhalten. Wenn ein Teilnehmer nicht bis zum Ende des Tages T, an dem ein Short Code gesendet wurde, die entschlüsselte Kennung für einen Short Code übermittelt, wird Eurex Deutschland am nächsten Handelstag den Teilnehmer über die fehlenden Daten informieren. Der Teilnehmer muss sicherstellen, dass die Daten spätestens bis zum nächsten Handelstag (T+1) vor 23:30 Uhr MEZ vervollständigt werden. Es ist geplant, die Funktion zum Hochladen der Mapping-Datei bis 18. September 2017 zur Verfügung zu stellen.

1.5 Due Diligence-Anforderungen

- **Regulatorische Anforderung**

Gemäß Artikel 48 (1) der Richtlinie 2014/65/EU und Artikel 7 von RTS 7 muss Eurex Deutschland jedes Jahr eine risikobasierte Beurteilung ihrer Teilnehmer durchführen und prüfen, ob die Teilnehmer als Wertpapierfirmen zugelassen sind.

- **Allgemeines Format**

Die Teilnehmer erhalten einen „Due Diligence Questionnaire“, der Fragen zu den folgenden Bereichen enthält:

- 1) Vorhandelskontrollen von Preis, Volumen und Wert der Aufträge sowie Systemverwendung und Nachhandelskontrollen der von den Teilnehmern ausgeführten Handelsaktivitäten;
- 2) Qualifikationsanforderungen an Mitarbeiter, die bei den Teilnehmern Schlüsselpositionen bekleiden;
- 3) Technische und funktionale Konformitätstests;
- 4) Richtlinien für die „Kill“-Funktion;

- 5) Eintragung als „Wertpapierfirma“ wie in Artikel 4 (1) der Richtlinie 2014/65/EU definiert;
- 6) Sofern der Teilnehmer seinen Kunden direkten elektronischen Zugang zum System gewährt, eine Beschreibung der Ausgestaltung des Zugangs sowie der von den Kunden zu erfüllenden Bedingungen;
- 7) Anwendbarkeit von MiFID II und MiFIR auf den Teilnehmer.

- **Übermittlung**

Es ist geplant, den „Due Diligence Questionnaire“ ab dem 18. September 2017 in der Eurex Member Section abrufbar zu machen. Die Teilnehmer müssen den Fragebogen ausfüllen und ihn in die Eurex Member Section hochladen. Bestehende Teilnehmer müssen den „Due Diligence Questionnaire“ erstmalig bis Januar 2019 ausfüllen. Neue Teilnehmer, die nach dem 31. Dezember 2017 zugelassen werden, müssen die erforderliche Information bei der Zulassung liefern.

1.6 Kontaktpersonen bei den Teilnehmern

Um eine effektive Bereitstellung von Informationen zu gewährleisten, bitten wir alle Handelsteilnehmer, sich in der Eurex Member Section auf www.eurexchange.com zu registrieren bzw. zu prüfen, ob ihr Release-Kontakt und Regulatorischer Koordinator dort hinterlegt sind. Wenn Sie hierzu Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, kontaktieren Sie bitte Ihren Client Services Cash & Derivatives Key Account Manager auf oder schreiben Sie an regulatory.support@deutsche-boerse.com.

2. Erweiterung der Orderdatensätze in T7

Die neuen Felder *Client ID* (für das Feld „Kundenidentifikationscode“), *Execution ID* und *Execution Qualifier* (für das Feld „Anlageentscheidung innerhalb der Firma“), *Investment ID* und *Investment Qualifier* (für das Feld „Anlageentscheidung innerhalb der Firma“) und *Liquidity flag* (für das Feld „Liquiditätszufuhr“) werden mit den für den 4. Dezember 2017 geplanten T7 Release 6.0 eingeführt.

Das Feld *Execution ID* wird das bestehende Feld Compliance ID ersetzen.

Das bestehende Feld *Member ID* wird für die Identifikation des Teilnehmers des Handelsplatzes beibehalten. Eurex Deutschland wird den LEI des Teilnehmers mit der regulatorischen Transaktionsmeldung an die zuständigen Behörden übermitteln. Wenn ein Händler die Ausführungs- oder Anlageentscheidung getroffen hat, wird dementsprechend das bestehende Feld *Trader ID* genutzt, um für die Transaktionsmeldung die zugehörige National ID zu ermitteln.

2.1 Client ID

Dies ist ein numerisches 8-Byte-Feld, das mit dem Short Code für die Identifizierung des direkten Kunden des Teilnehmers befüllt werden muss. Die folgenden vordefinierten Short Codes müssen zur Kennzeichnung von aggregierten Orders, ausstehenden Zuweisungen oder für Fälle genutzt werden, in denen kein Kunde an der Order beteiligt ist:

- 0 – Kein Kunde für diese Order
- 1 – Kennzeichen für aggregierte Orders „AGGR“
- 2 – Kennzeichen für noch ausstehende Zuweisung „PNAL“

Die Teilnehmer müssen das Feld *Client ID* bei allen Kundentransaktionen befüllen (Ordereingabe/-änderung)

2.2 Execution ID und Execution Qualifier

- **Allgemeines Format**

Die folgenden Eingaben müssen für den **Execution Qualifier** genutzt werden:

- 22 – Wenn der Entscheider ein Algorithmus ist oder die Anlageentscheidung vom Kunden getroffen wurde
- 24 – Wenn der Entscheider eine natürliche Person ist

Die Befüllung des Feldes Execution Qualifier ist obligatorisch.

Das Feld **Execution ID** ist ein numerisches 8-Byte-Feld, das wie folgt befüllt werden muss:

- mit der Algo ID, wenn die Anlageentscheidung vorrangig durch einen Algorithmus getroffen wurde
- mit dem Short Code der National ID der Person beim Teilnehmer, die vorrangig verantwortlich für die Ausführungsentscheidung ist, wenn diese Person nicht der Händler ist, der die Order-/die Quote-Transaktion übermittelt
- mit dem Short Code „3“, wenn die Ausführungsentscheidung vom Kunden getroffen wurde.

Wenn die Ausführungsentscheidung vorrangig von dem Händler getroffen wurde, der auch die Order-/Quote-Transaktion übermittelt, muss das Feld leer bleiben während das Feld Execution Qualifier mit dem Wert 24 gefüllt wird.

Nr.	Szenario	Execution Qualifier	Execution Identifier	Meldung von „Ausführungsentscheidung innerhalb der Firma“ an die zuständige Behörde
1	Die Entscheidung wurde innerhalb des Teilnehmer-Unternehmens getroffen. Der Entscheider ist vorrangig ein Algorithmus.	22 (Algorithmus)	Algo ID	Algo ID
2a	Die Ausführungsentscheidung wurde innerhalb des Teilnehmer-Unternehmens getroffen. <u>Der Entscheider ist eine natürliche Person, welche nicht der Händler ist, der die Order/den Quote übermittelt.</u>	24 (natürliche Person)	Short Code	National ID
2b	Die Ausführungsentscheidung wurde innerhalb des Teilnehmer-Unternehmens getroffen. Der Entscheider ist der Händler, welcher die Order/den Quote übermittelt.	24 (natürliche Person)	Leer	National ID des eingebenden Händlers
3	Die Ausführungsentscheidung wurde nicht innerhalb des Teilnehmer-Unternehmens getroffen, sondern vom Kunden.	22 (Algorithmus)	3	„CLIENT“

Tabelle 3: Befüllung der Felder Execution ID und Execution Qualifier

Es liegt in der Verantwortung der Teilnehmer, den Entscheider zu ermitteln, (z. B. Algorithmus, juristische Person, natürliche Person oder Kunde), der in Übereinstimmung mit deren Governance-Regeln vorrangig für die Ausführung verantwortlich ist.

Die Teilnehmer müssen die Felder Execution Qualifier und Execution ID für alle Transaktionen direkt bei Ordereingabe/-änderung/-löschung nach der in Tabelle 3 beschriebenen Methodik befüllen.

2.3 Investment ID und Investment Qualifier

- **Allgemeines Format**

Wenn ein Teilnehmer „in einer anderen Kapazität“ handelt, können beide Felder leer gelassen werden. Wenn der Teilnehmer auf eigene Rechnung handelt, müssen die Felder gefüllt werden, daher ist das Feld „Anlageentscheidung innerhalb der Firma“ obligatorisch für alle Transaktionen auf den Eigenkonten der Teilnehmer.

Die folgenden Eingaben müssen für den **Investment Qualifier** genutzt werden:

- 22 – wenn der Entscheider ein Algorithmus ist
- 23 – wenn der Entscheider ein Unternehmen ist
- 24 – wenn der Entscheider eine natürliche Person ist

Im Falle einer Kundenorder muss das Feld leer gelassen werden.

Das Feld **Investment ID** ist ein numerisches 8-Byte-Feld, das wie folgt befüllt werden muss:

- mit der Algo ID, wenn die Anlageentscheidung vorrangig durch einen Algorithmus getroffen wurde
- mit dem Short Code der National ID der Person beim Teilnehmer, die vorrangig verantwortlich für die Ausführungsentscheidung ist, wenn diese Person nicht der Händler ist, der die Order-/die Quote-Mitteilung übermittelt
- wenn die Ausführungsentscheidung von derselben Person getroffen wurde, welche die Order-/die Quote-Mitteilung übermittelt, muss das Feld leer gelassen werden.

Nr.	Szenario	Investment Qualifier	Investment Identifier	Meldung von „Ausführungsentscheidung innerhalb der Firma“ an die zuständige Behörde
1	Die Anlageentscheidung wurde innerhalb des Teilnehmer-Unternehmens getroffen und dieses handelt für eigene Rechnung. Die Anlageentscheidung ist durch einen Algorithmus getroffen worden.	22 (Algorithmus)	Algo ID	Algo ID
2a	Die Anlageentscheidung wurde innerhalb des Teilnehmer-Unternehmens getroffen und dieses handelt für eigene Rechnung. Die Anlageentscheidung ist von einer natürlichen Person getroffen worden, die nicht der Händler ist, welcher die Order/den Quote übermittelt.	24 (natürliche Person)	Short Code	National ID des Entscheiders

Nr.	Szenario	Investment Qualifier	Investment Identifier	Meldung von „Ausführungsentscheidung innerhalb der Firma“ an die zuständige Behörde
2b	Die Anlageentscheidung wurde innerhalb des Teilnehmer-Unternehmens getroffen und dieses handelt für eigene Rechnung. Der Entscheider ist der Händler, der die Order/den Quote übermittelt.	24 (natürliche Person)	Leer	National ID des eingebenden Händlers
3	Die Ausführungsentscheidung wurde nicht innerhalb des Teilnehmer-Unternehmens getroffen, und dieser handelt „in einer anderen Kapazität“.	22 (Algorithmus)	3	„CLIENT“

Tabelle 4: Befüllung der Felder Investment ID und Investment Qualifier

Teilnehmer müssen die Felder „Investment Qualifier“ und „Investment ID“ für alle Eigenhandels-transaktionen direkt bei der Ordereingabe/-änderung/-löschung befüllen.

2.4 Liquiditätszufuhr

- **Regulatorische Anforderung**

Gemäß Artikel 3 von RTS 24 müssen Teilnehmer Orders **als Liquiditätszufuhr** kennzeichnen, wenn

- eine Order von einem Teilnehmer an einen Handelsplatz im Rahmen einer Market-Making-Strategie gemäß den Artikeln 17 und 48 der Richtlinie 2014/65/EU eingegeben wird;
- eine Order von einem Teilnehmer an einen Handelsplatz im Rahmen einer sonstigen Liquiditätsversorgungsmaßnahme übermittelt wird und dies aktiv auf der Grundlage von Bedingungen geschieht, die vorab entweder vom Emittenten des Instruments, das Gegenstand der Order ist, oder vom entsprechenden Handelsplatz festgelegt wurden.

- **Allgemeines Format**

„zutreffend“ oder „nicht zutreffend“

- **Übermittlung**

Durch ein neues Feld im Handelssystem.

- **Frist für die Übermittlung**

Sofort bei der Eingabe von Orders oder Quotes.

- **Standardspezifikation**

Der Liquidity Provision Indicator ist ein optionales Feld für Order- und Quoteeingaben. Wenn der Liquidity Provision Indicator vom Teilnehmer nicht befüllt wird, wertet Eurex Deutschland dies standardmäßig als Wert „nicht zutreffend“, d. h. keine Liquiditätszufuhr.

Procedure to generate CONCAT

CONCAT

The CONCAT identifier consists of

- ISO code for country of nationality (2 characters)
- Date of birth (format YYYYMMDD = 8 characters)
- First name (first 5 characters after cleansing)
- Last name (first 5 characters after cleansing)

For first name and last name, the cleansing procedure consists of the following steps:

1. Obtaining the first name and surname

To minimise the risk of difference in spelling or use of abbreviations, the Investment Firm should ensure that the spelling of the person's full name is correct. Any use of short forms and abbreviations is not allowed.

2. Removing titles

Any prefixes to the names that denote titles, position, profession or academic qualifications, are to be removed. This includes, but is not limited to, the following list; this list is not case sensitive:

atty, coach, dame, dr, fr, gov, honorable, madam(e), maid, master, miss, monsieur, mr, mrs, ms, mx, ofc, ph.d, pres, prof, rev, sir

3. Removing prefixes

am, auf, auf dem, aus der, d, da, de, de l', del, de la, de le, di, do, dos, du, im, la, le, mac, mc, mhac, mhíc, mhic giolla, mic, ni, ní, níc, o, ó, ua, ui, uí, van, van de, van den, van der, vom, von, von dem, von den, von der

Prefixes to surnames that are not included above, or prefixes attached to the name, i.e. McDonald, MacChrystal, O'Brian, O'Neal, should not be removed; but note that the apostrophes will be removed in the next step. The above list is not case sensitive.

4. Transliteration of apostrophes, accents, hyphens, spaces and similar

The following transliteration table should be applied, character by character, to the first name and surname. Generally described, the transliteration leaves any English A-Z or a-z character untouched and removes all the diacritics, apostrophes, hyphens, punctuation marks and spaces.

The following table maps a single input character to a single output character. This table should be applied to first name and surname prior to obtaining the five first characters, as specified in Article 6(4) of RTS 22.

For any names that are written in Cyrillic, Greek or any other non-Latin alphabet, and where no Latin form is present, a transliterated English version of the name should be applied using that alphabet's conventions.

5. Convert all special characters (non A-Za-z) according to the following table

6. Convert all characters to uppercase

7. Fill missing characters with “#”

Output	Input	Input Unicode code points
A	Ă ă Â â Á á Ã ã Ä ä Å å Æ æ	U+00C4 U+00E4 U+00C0 U+00E0 U+00C1 U+00E1 U+00C2 U+00E2 U+00C3 U+00E3 U+00C5 U+00E5 U+01CD U+01CE U+0104 U+0105 U+0102 U+0103 U+00C6 U+00E6
C	Ç ç Ć ć Ĉ ĉ Č č	U+00C7 U+00E7 U+0106 U+0107 U+0108 U+0109 U+010C U+010D
D	Đ đ Ð ð	U+010E U+0111 U+0110 U+010F U+00F0
E	È è É é Ê ê Ë ë Ě ě Ę ę	U+00C8 U+00E8 U+00C9 U+00E9 U+00CA U+00EA U+00CB U+00EB U+011A U+011B U+0118 U+0119
G	Ĝ ĝ Ğ ğ Ģ ģ	U+011C U+011D U+0122 U+0123 U+011E U+011F
H	Ĥ ĥ	U+0124 U+0125
I	İ i Í í Î î Ï ï	U+00CC U+00EC U+00CD U+00ED U+00CE U+00EE U+00CF U+00EF U+0131
J	Ĵ ĵ	U+0134 U+0135
K	Ƙ ƙ	U+0136 U+0137
L	Ł ł Ľ ľ Ļ ļ	U+0139 U+013A U+013B U+013C U+0141 U+0142 U+013D U+013E
N	Ñ ñ Ń ń Ņ ņ	U+00D1 U+00F1 U+0143 U+0144 U+0147 U+0148
O	Ö ö Ò ò Ó ó Ô ô Õ õ Ö ö Ø ø OE oe	U+00D6 U+00F6 U+00D2 U+00F2 U+00D3 U+00F3 U+00D4 U+00F4 U+00D5 U+00F5 U+0150 U+0151 U+00D8 U+00F8 U+0152 U+0153
R	Ŕ ŕ Ŗ ŗ	U+0154 U+0155 U+0158 U+0159
S	ß ß Ś ś Š š Ş ş Š š Ş ş Ş ş	U+1E9E U+00DF U+015A U+015B U+015C U+015D U+015E U+015F U+0160 U+0161 U+0218 U+0219
T	Ŧ ŧ Ț ț Ț ț	U+0164 U+0165 U+0162 U+0163 U+00DE U+00FE U+021A U+021B
U	Ü ü Û û Ú ú Û û Ů ů Ů ů Ů ů Ů ů	U+00DC U+00FC U+00D9 U+00F9 U+00DA U+00FA U+00DB U+00FB U+0170 U+0171 U+0168 U+0169 U+0172 U+0173 U+016E U+016F
W	Ŵ ŵ	U+0174 U+0175
Y	Ý ý Ŷ ŷ Ÿ Ź ź	U+00DD U+00FD U+0178 U+00FF U+0176 U+0177
Z	Ž ž Ž ž Ž ž	U+0179 U+017A U+017D U+017E U+017B U+017C
{DELETE}	Except a-z and A-Z, all other characters not listed above should be removed	

Examples:

First name(s)	Family name/ Surname(s)	Date of birth	Country code + CONCAT	Comment
John	O'Brian	13-01-1980	IE19800113JOHN#OBRIA	O' is attached to name, not converted. Remove apostrophe.
Ludwig	Van der Rohe	14-02-1981	HU19810214LUDWIROHE#	Removed prefix 'Van der'.
Victor	Vandenberg	22-03-1973	US19730322VICTOVANDE	'Van' is attached, not considered a prefix.
Eli	Ødegård	15-03-1976	NO19760315ELI##ODEGA	Padded 'Eli' to 5 characters. Converted Ø to O, and å to A.
Wileke	de Bruijn	16-04-1966	LU19660416WILLEBRUIJ	Removed prefix 'De'.
Jon Ian	Dewitt	17-04-1965	US19650417JON##DEWIT	Ignored 'Ian', only first name shall be used. 'De'-part of 'Dewitt' is not a prefix.
Amy-Ally	Garção de Magalhães	17-05-1990	ES19900517AMYALGARCA	Removed hyphen from first name. Transliterated characters.
Giovani	dos Santos	18-06-1990	FR19900618GIOVASANTO	Removed prefix.
Günter	Voß	15-07-1980	DE19800715GUNTEVOS##	Converted ü to U, and ß to S.

More details can be found here:

https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2016-1452_guidelines_mifid_ii_transaction_reporting.pdf